A democracia reduz a desigualdade econômica?

Um estudo sobre as possibilidades de construção de uma sociedade mais igual por meio da democracia

Ivan Filipe de Almeida Lopes Fernandes

FERNANDES, I.F.A.L. *A democracia reduz a desigualdade econômica?* Um estudo sobre as possibilidades de construção de uma sociedade mais igual por meio da democracia [online]. São Bernardo do Campo, SP: Editora UFABC, 2017, 301 p. ISBN: 978-85-68576-79-3. https://doi.org/10.7476/9788568576793.

A DEMOCRACIA REDUZ A DESIGUALDADE ECONÔMICA?

Um estudo sobre as possibilidades de construção de uma sociedade mais igual por meio da democracia

IVAN FILIPE DE ALMEIDA LOPES FERNANDES

A DEMOCRACIA REDUZ A DESIGUALDADE ECONÔMICA?

Um estudo sobre as possibilidades de construção de uma sociedade mais igual por meio da democracia

Editora UFABC

São Bernardo do Campo - SP
2017

Agradecimentos

Gostaria de agradecer aos que contribuíram de maneira decisiva para a realização deste trabalho, fruto de minha pesquisa de doutoramento, agora transformada em livro. É um grande prazer agradecer a todos pelo enorme auxílio prestado das mais diversas formas possíveis.

Em primeiro lugar gostaria de agradecer àqueles que viabilizaram de forma direta à produção desta pesquisa.

Agradeço à professora Maria Hermínia Tavares de Almeida, orientadora, cuja dedicação, conselhos, críticas precisas e método de trabalho foram cruciais para o andamento e evolução desta pesquisa e do próprio autor como pesquisador. Agradeço também ao professor José António Cheibub, coorientador durante minha estadia na Universidade de Illinois, em Urbana-Champaign.

Agradeço ao apoio institucional prestado pelo Departamento de Ciência Política (DCP) da Faculdade de Filosofia, Letras e Ciências Humanas (FFLCH) da Universidade de São Paulo – USP que viabilizou e forneceu a infraestrutura necessária e o apoio institucional para a finalização desta pesquisa; ao *Conselho Nacional de Desenvolvimento Científico e Tecnológico* – CNPq e à *Coordenação de Aperfeiçoamento de Pessoal de Nível Superior* - CAPES, que apoiaram financeiramente o trabalho. O primeiro responsável pelo financiamento dos

estudos durante o doutoramento e a segunda responsável pela Bolsa Sanduíche usufruída no Departamento de Ciência Política da Universidade de Illinois, em Urbana-Champaign (UIUC). Agradeço também a contribuição da Universidade Federal do ABC (UFABC), instituição que me abrigou após o término do doutorado e quem, por meio de sua Editora (Editora UFABC) propiciou a publicação desta pesquisa de doutorado no formato de livro.

O trabalho se beneficiou muito da experiência como *visiting scholar* na UIUC. Em particular gostaria de agradecer às contribuições dos professores James H. Kuklisnk e Matthew S. Winters com quem tive a dupla satisfação de ser aluno e poder discutir pessoalmente os caminhos desta pesquisa. Gostaria também de agradecer aos professores e colegas do DCP/USP.

Gostaria de agradecer também aos professores Walter Beluzzo e Sérgio Firpo cujos comentários a respeito da metodologia desta pesquisa foram de fundamental importância para o sucesso do trabalho, assim como ao professor Bruno Càutres com quem tive a oportunidade de trabalhar como monitor nas *IPSA Summers Schools* de 2012 e 2013 e pude apresentar e discutir minhas ideias de pesquisa.

É importante lembrar também a contribuição de David Samuels, Ben Ansell, Christian Houle, Salvatore J. Babones, María José Alvarez-Rivadulla e James K. Galbraith por terem cedido parte dos dados de suas pesquisas, além de terem sido extremamente atenciosos ao responderem com bastante cuidado aos e-mails de um jovem pesquisador.

Aos companheiros do Polmet, grupo de estudos e orientação organizado pela professora orientadora Maria Hermínia, juntamente com os professores Leandro Piquet Carneiro e Cristiane Lucena Carneiro e os colegas pesquisadores Nadim

Gannoum, Lucas Cadah, Juliana Costa, Laerte Apolinário, Bruno Lopes, Suhayla Khalil e Andreas Werner, cujos comentários, críticas e conselhos foram fundamentais para a evolução do argumento e da pesquisa empírica. Aproveito também para agradecer aos companheiros da vida acadêmica no IRI e DCP – USP. Em especial, gostaria de agradecer todo apoio de Leandro Consentino, Marcello Baird, Lara Mesquita, Vitor Oliveira e Humberto Dantas.

Em especial, gostaria de agradecer as contribuições dos colegas do Grupo de Economia Política (GEP) sediado no IRI/USP, Flávio Pinheiro, Gabriel Cepaluni, Rafael Magalhães e Gustavo Araújo, que analisaram e discutiram longamente os esboços desta pesquisa.

Por fim, e mais importante, gostaria de agradecer a todos aqueles que me deram o apoio afetivo e emocional fundamental no percurso desta jornada, a quem dedico integralmente esta pesquisa:

À Duda, ao Lucas e à Mari que me propiciaram uma das maiores felicidades de minha vida ao me permitirem tornarme parte de sua família. À Mércia e às minhas cunhadas, Helen e Heliane, por todo o apoio, carinho e compreensão. À Isabela, Laura e Miriam por todo o incentivo e apoio. À Fabi e ao André por todo o apoio e cuja ajuda foi crucial para que pudesse morar nos EUA sem grandes preocupações.

Aos membros da minha família que são a essência de tudo que sou! Aos meus pais, Diogo e Nina Rosa, os grandes mestres de minha vida, cujo exemplo, dedicação e carinho são imensuráveis e incomparáveis. À minha tia/madrinha Sônia, sempre muito querida, e aos meus irmãos, Gustavo e Guilherme, que sempre me apoiaram, discutiram, estiveram e estarão por perto, seja nos momentos difíceis, nas grandes celebrações e mesmo no dia a dia de todo o sempre.

À minha amada Heloísa, cujo carinho e compreensão superam o limite do compreensível, me ajudando em tudo em minha vida, minhas faltas ao longo deste projeto, e a atenção nos momentos mais nervosos, vibrando com minhas vitórias e com quem percorrerei de mãos dadas toda essa fabulosa jornada chamada Vida. E, finalmente, ao Filipinho, nosso primeiro filho, que veio para alegrar ainda mais nossa vida e todos os futuros passos de nossa família.

Lista de figuras

Lista de gráficos

Lista de quadros

Lista de tabelas

Lista de abreviaturas

BM - GINI	Coeficientes de GINI de Bourguignon e Morrisson (2002)
CPS/FGV	Centro de Políticas Sociais da FGV
DS	Coeficientes de GINI de Deininger e Squire (1996)
EHII	Estimated Household Income Inequality
FGV	Fundação Getúlio Vargas
FH	Freedom House
GLM	Generalized Linear Models
IBGE	Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística
IHME	Institute for Health Metrics and Evaluation
ISIC	International Standard Industrial Classification
LIS	Luxembourg Income Study
MQO	Regressão por Mínimos Quadrados Ordinários
ONU	Organizações das Nações Unidas
PBF	Programa Bolsa Família

PME	Pesquisa Mensal de Emprego
PNAD	Pesquisa Nacional por Amostra de Domicílios
PWT	Penn World Tables
RQ	Regressão Quantílica
SIID	Standardized Income Inequality Data
SWIID	Standardized World Income Inequality Database
UNIDO	United Nations Industrial Development Organization
UNU	United Nations University
WIDER	The World Institute for Development Economics Research
UTIP	University of Texas Inequality Project
WDI	World Development Indicators
WIID	The World Income Inequality Database

Sumário

Introdução

Segundo dados divulgados pela Fundação Getúlio Vargas a desigualdade econômica no Brasil atingiu em 2011 o nível mais baixo desde que começou a ser computada na década de 1960. No período posterior à transição democrática da década de 1980, mais exatamente a partir de 1993, sete anos após a democratização do país, a desigualdade econômica mensurada pelo coeficiente de GINI passou a apresentar expressiva tendência de queda (NERI, 2012).

Em 2010 este índice cruzou o patamar mais baixo de valores de GINI do Brasil – computados em 1960, entrando no décimo segundo ano consecutivo de queda de desigualdade. Em 2011, a inclinação desta tendência negativa era mais aguda do que no começo da curva, apresentando uma taxa de queda duas vezes maior que a dos primeiros anos do processo, o que indica que a redução da desigualdade econômica no Brasil continua sendo um movimento de fôlego. O coeficiente de GINI caiu de 0.607 em 1993, ápice da desigualdade, para 0.519 em janeiro de 2012, 3.3% do patamar estabelecido em 1960. No Gráfico 1 apresentamos a evolução destes dados a partir de 1992.

COEFICIENTE DE GINI

Ano	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011
Coeficiente de GINI	0,583	0,607	0,603	0,599	0,602	0,600	0,600	0,594	0,595	0,596	0,589	0,583	0,571	0,568	0,562	0,555	0,549	0,545	0,538	0,519
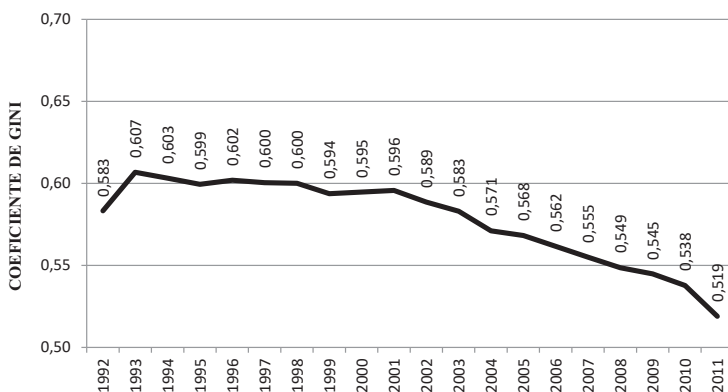
Gráfico 1 – Coeficiente de GINI no Brasil a partir dos anos 1990
Fonte: Microdados da PNAD / IBGE (CPS / FGV) (NERI, 2012)

A evolução da desigualdade econômica no Brasil é um processo intrigante devido ao fato de que seu crescimento e redução têm acompanhado os principais eventos que marcaram a vida política e econômica nacional. O crescimento da desigualdade ao longo das décadas de 1960-80 é considerado por muitos como o resultado deliberado da estratégia de modernização econômica adotada pelo Regime Militar, que privilegiou a construção de um setor moderno da economia à custa dos setores mais tradicionais e de uma menor participação dos salários no valor adicional agregado da economia.

A partir da transição democrática na década de 1980, sobretudo após a transferência do poder para os civis, da eleição direta do Presidente da República e da expansão dos direitos políticos para os analfabetos, as demandas dos grupos menos favorecidos na sociedade vieram à tona, ganhando a denominação de "dívida social". Esse processo teve como consequência a criação, ao longo dos últimos 25 anos, de um sistema de proteção social bastante abrangente, incluindo um

sistema de saúde gratuito, público e universal e uma ampla rede de assistência social, que inclui – entre outros projetos – inúmeros programas de sustentação de renda. Destacam-se também as reformas e alterações promovidas em esferas essencialmente econômicas, como, por exemplo, a facilitação do microcrédito, ou mesmo medidas relacionadas ao mercado de trabalho como a sustentação de aumentos reais no salário mínimo; vetores que impactam e aceleram o processo de redução da desigualdade.

Uma das principais consequências destes desdobramentos políticos foi um crescimento agudo da desigualdade entre as décadas de 1960 e 1990, seguido de impressionante redução iniciada a partir de 1993. No Gráfico 2 apresentamos uma visão de longo prazo da desigualdade no Brasil desde a década de 1960, o que deixa claro o formato em U-invertido da curva de evolução da desigualdade econômica no Brasil.

Tendo em vista estes dados preliminares sobre a relação entre os tipos de regimes políticos e a evolução da desigualdade econômica no Brasil, questionamos quais são os elementos últimos que explicariam de fato as razões do crescimento da desigualdade durante o Regime Militar e a sua posterior queda após a redemocratização. Seria o caso brasileiro uma evidência importante de que a democracia é realmente capaz de exercer o seu papel fundamental de reduzir as diferenças entre as pessoas e as ditaduras, por sua vez, estão associadas a processos de fomento à desigualdade? Isto é, a extensão do direito ao voto dado ao segmento mais pobre da população durante a década de 1980, combinado com a permissão da livre escolha por parte dos cidadãos dos seus principais líderes políticos seriam os principais fatores explicativos da inflexão da curva da desigualdade econômica brasileira de maneira tão abrupta,

revertendo um longo processo de trinta anos ininterruptos de crescimento da desigualdade econômica?
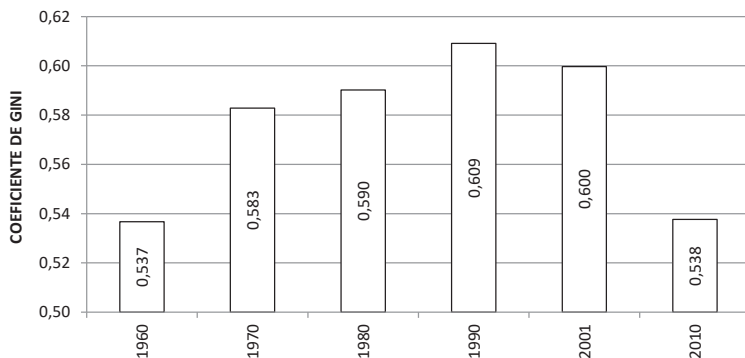
Gráfico 2 – Visão de longo prazo do coeficiente de GINI no Brasil
Fonte: Microdata da PNAD / PME e Censo (CPS / FGV) (Neri, 2012)
Obs: Transição Autoritária – 1964. Transição Democrática – 1985.

Nessa pesquisa tentamos responder esta questão tomando o caso brasileiro como apenas mais um dentro da perspectiva histórica comparada da relação entre democracia e desigualdade. Isto posto, adotamos como indagação principal a ser respondida ao longo do trabalho:

"Seria a democracia um importante componente do processo de redução da desigualdade econômica dentro de uma determinada comunidade política"?

Esta pergunta já foi feita antes mesmo de a revolução democrática do século XX, quando verdadeiramente houve a criação de sistemas políticos nos quais a expansão do sufrágio atingiu toda a população adulta. A expectativa levantada no século XIX por filósofos políticos, tanto conservadores

quanto progressistas, era que a criação e expansão do sufrágio universal estaria associada inevitavelmente à redução da enorme desigualdade econômica produzida pelas economias capitalistas a partir da Revolução Industrial. E, possivelmente, teria como consequência natural, trágica para os conservadores e redentora para os socialistas, o fim do sistema de proteção aos direitos de propriedade.

Apesar disso, um fato bastante corriqueiro das previsões feitas por cientistas sociais é sua refutação pela história. Boa parte das consequências políticas empíricas é muitas vezes inesperada e não respalda as expectativas anteriormente formuladas. Diante disso, nos perguntamos se as expectativas dos filósofos políticos do século XIX encontraram algum respaldo empírico na jornada da democracia do século XX?

A previsão de que a democracia é capaz de transformar direitos políticos equitativamente distribuídos em recursos econômicos mais igualmente distribuídos se realizou ou a relação entre democracia e desigualdade tornou-se essencialmente ortogonal e os temores levantados por políticos e filósofos políticos conservadores no século XIX demonstraram-se infundados?

Observando mais uma vez o caso brasileiro, é possível formular uma explicação alternativa para o padrão U-invertido da evolução da desigualdade econômica nas últimas cinco décadas, no qual o desenvolvimento econômico seria o principal determinante deste processo. A conexão entre a democratização e uma queda abrupta da desigualdade mensurada pelo coeficiente de GINI seria nessa explicação apenas um resultado espúrio da associação que o desenvolvimento econômico possui tanto com o sucesso de um sistema democrático, quanto com a própria distribuição de recursos econômicos da

sociedade. Isto é, a relação entre democracia e desigualdade seria espúria ao papel desempenhado por outras variáveis que importam mais.

Segundo a narrativa econômica tradicional, o próprio processo de modernização econômica da sociedade, seguindo os padrões estabelecidos pelo economista Simon Kuznets (1955), guiam a evolução da democracia e da desigualdade. E o ápice da desigualdade se encontra justamente no processo de adaptação e transição de uma sociedade rural para uma sociedade urbana, com uma posterior queda a partir do momento em que a economia urbanizada e industrializada atinge certa maturidade no processo de desenvolvimento.

Dentro desta perspectiva, é possível que tanto o sucesso democrático brasileiro pós-1985 quanto a redução da desigualdade pós-1993 estejam associadas ao avanço e maturidade do desenvolvimento econômico do país. E assim, nesta explicação, tanto o aumento quanto a queda da desigualdade seriam nada mais que consequências do processo de desenvolvimento e temporalmente alinhadas, mas independentes dos momentos autoritários e democráticos.

Na contramão do exemplo brasileiro, pesquisas recentes sobre a evolução da desigualdade econômica nos Estados Unidos e nas economias mais desenvolvidas da Europa Ocidental e do Japão demonstram que no último quarto do século XX e na primeira década do século XXI, a desigualdade nas nações mais ricas do planeta cresceu de maneira substantiva, ainda que ao longo de todo esse período estes países tenham sempre mantido uma estrutura política democrática. Piketty (2014). Piketty e Saez (2003), por exemplo, mostram dados a respeito de um crescimento consistente da desigualdade estadunidense desde 1970, sobretudo em favor do topo da distribuição de

renda e com grandes picos no crescimento da renda do 1% mais rico do país no final da década de 1980. Piketty (2014) e Piketty e Saez (2006) mostram que o mesmo padrão se repete nas democracias britânica, japonesa, francesa e canadense.

A evolução da desigualdade americana tem um formato de U ao longo do século XX. Enquanto no início do século, período conhecido como *Gilded Age*, a desigualdade econômica dentro dos EUA era pervasiva, sendo que os 5% mais ricos detinham mais de 40% da renda nacional, enquanto o 1% mais rico detinha aproximadamente 25%; o período pós-Grande Depressão, incluindo o pós-Segunda Guerra Mundial, é marcado por um constante processo de redução das disparidades econômicas dentro do país, atingindo seu patamar mínimo em 1975, quando o 1% mais rico detinha cerca de 10% da renda nacional e os 5% mais ricos cerca de 25%. Após a onda liberal inaugurada pelo presidente republicano Ronald Reagan, esse processo sofreu uma inflexão e na última década os Estados Unidos apresentaram patamares de concentração de renda semelhantes ao início do século XX e, por tal, o período foi denominado por Larry Bartels (2008) como a *New Gilded Age*.

Contudo, uma consideração importante a ser feita sobre estes dados de crescimento da desigualdade no mundo desenvolvido é que a mera constatação de que países democráticos, como os exemplos dos Estados Unidos, Reino Unido e Canadá, tenham apresentado consistente aumento da desigualdade econômica não significa necessariamente que a democracia não é um vetor de redução da desigualdade entre as pessoas. É plausível argumentar – embora impossível de comprovar empiricamente – que caso estes países tivessem sido governados por regimes autoritários nas últimas décadas, o aumento da desigualdade teria sido muito maior do que o ocorrido.

Tal argumento é enfatizado por aqueles que entendem que o processo de aumento da desigualdade nas últimas décadas do século XX independe da política e reflete, outrossim, os efeitos da expansão da globalização da economia mundial e das novas tecnologias da Revolução Tecnocientífica, que aumentaram os retornos salariais do capital humano mais qualificado (WOOD, 1994; NECKERMAN; TORCHE, 2007; AUTOR, 2010; BOIX, 2011; SPENCE; HLATSHWAYO, 2012).

A importância desta questão de pesquisa decorre, portanto, do papel crucial que é dado à democracia por cientistas sociais, políticos e cidadãos como mecanismo facilitador de criação de condições de maior igualdade econômica. Contudo, ainda que este papel seja bastante debatido, é pouco clara qual é a contribuição efetiva da democracia para o problema da desigualdade, apesar de existir uma percepção generalizada e normativa de que a democracia deva estar relacionada e mesmo ser a promotora de cidadania mais igual. Como apresentaremos no Capítulo 1, a literatura que trata desta relação entre democracia e desigualdade é extremamente vasta e ainda não chegou perto de algum consenso sobre os principais padrões dessa relação, sobretudo do ponto de vista empírico.

Inclusive, análises recentes que fizeram uso de alguns dos melhores dados disponíveis para discutir os determinantes da desigualdade econômica obtiveram resultados divergentes. Entre os últimos estudos podemos citar Li, Squire e Zou (1998); Chong (2004); e Reuveny e Li (2003) que encontraram uma associação forte e negativa entre democracia e desigualdade, enquanto Timmons (2010) replicou as três análises em um banco de dados maior, construído e expandido a partir dos mesmos critérios dos dados daqueles autores, e não encontrou nenhuma relação significativa.

Em relação a esta literatura comparada, discutimos dois problemas fundamentais que foram pouco tratados e sobre os quais entendemos que reside a explicação da dificuldade dos avanços teóricos e empíricos sobre o tema.

Em primeiro lugar, boa parte das pesquisas que tentaram estimar o efeito da democracia sobre a desigualdade não levou em conta o fato de que existe uma potencial endogenia nesta relação. De um lado é plausível aventar a hipótese de que os regimes democráticos possuem efeitos equalizadores sobre a distribuição de recursos econômicos e do outro existe extensa literatura que aborda a questão de que a própria desigualdade é um dos componentes fundamentais dos processos de democratização. Conforme advogado em parte da literatura que estuda os determinantes da transição democrática, sociedades com altos níveis de desigualdade não são terrenos férteis para a democracia. A ameaça de redistribuição de riqueza estimularia a adoção de soluções antidemocráticas pelas elites política e econômica, que temem ser expropriadas de suas riquezas, caso o poder político passe para as mãos do povo (BOIX, 2003; ACEMOGLU; ROBINSON, 2006; HOULE, 2009).

Encontramos apenas dois estudos que de fato se esforçaram para analisar as duas relações simultaneamente (RUBINSON; QUINLAN, 1977; BOLLEN; JACKMAN, 1985). Em nosso trabalho, apresentamos uma abordagem de variável instrumental que permite superar os problemas e limitações decorrentes da potencial endogenia existente na relação. Ademais, incluímos na análise uma lista de variáveis instrumentais que nos permitem selecionar com confiança quais são os instrumentos que identificam a variável endógena de maneira adequada, sendo fortemente correlacionados com democracia e não com desigualdade.

Em segundo lugar, e como contribuição mais relevante da pesquisa, incorporamos novo elemento na análise da relação entre democracia e desigualdade econômica, que não foi trabalhado por nenhum estudo comparado. Desenvolvemos no Capítulo 2 e verificamos empiricamente no Capítulo 4 e 5 a hipótese de que os efeitos da democracia na redução da desigualdade social não são homogêneos ao longo da distribuição de desigualdade. Refutamos de maneira peremptória a suposição de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica são os mesmos em sociedades mais iguais e em sociedades mais desiguais. Em nossa hipótese e nos resultados apresentados constatamos que a democracia só possui efeitos redutores da desigualdade econômica justamente quando comparamos ditaduras e democracias entre os países mais desiguais das diferentes amostras utilizadas neste trabalho.

Para isso conjecturamos teoricamente que em sociedades mais igualitárias o tema da desigualdade não é discutido e tampouco a clivagem central do debate político democrático. Isto porque os indivíduos desejam que outros temas sejam tratados pelo sistema político, pelos partidos e pelas autoridades políticas. Temas estes que ocupam posição superior no ranking de problemas e prioridades existentes na sociedade, o que estimula que a disputa pelo eleitorado entre os partidos políticos sublinhe outros problemas mais sensíveis que o tema da desigualdade. Por outro lado, em sociedades desiguais, o tema da redução da desigualdade econômica é extremamente sensível e atrativo politicamente, de forma que os partidos que competem pelo voto popular tendem a utilizar esta temática como trunfo político, criando, portanto, um ciclo positivo de redução da desigualdade econômica por meio das políticas públicas desenvolvidas pelos partidos vitoriosos.

De acordo com o arcabouço teórico proposto, o processo político ocorrido no Leste Europeu após a democratização dos antigos satélites soviéticos não foge ao escopo de nossa teoria. O aumento dramático da desigualdade nesses países decorreu do fato que esse tema não deveria ser o foco de atenção principal dos partidos que competiam pelo poder político. Inclusive, existem fortes evidências que no imediato à transição democrática, a opinião pública do Leste Europeu estava interessada em outras temáticas e não no debate sobre a desigualdade econômica. Isto porque estas sociedades deixavam para trás regimes autoritários que produziram um nível elevado de igualdade social, estando no centro da disputa política outros temas julgados mais relevantes pelos membros dessas sociedades.

A evolução da opinião pública polonesa sobre a desigualdade ao longo da década de 1990 é clara sobre isto. No início do processo de democratização e transformação econômica a desigualdade foi enxergada segundo um viés positivo: reflexo da ampliação das oportunidades com as reformas econômicas pós-comunistas. Com o passar do tempo, a tolerância à crescente desigualdade reduziu-se, coincidindo com o crescimento da percepção de que os rendimentos elevados eram e são obtidos por meio de corrupção e outros processos injustos (GROSFELD; SENIK, 2010).

Outro exemplo das diferentes visões a respeito da necessidade de redistribuição de renda é obtido com a análise da opinião pública chinesa, país onde o crescimento da desigualdade econômica não é observado pela população como um grande problema, mas sim como reflexo de uma maior abertura à livre iniciativa e à capacidade de ascensão pessoal dentro dessa sociedade marcada por um sistema autoritário que por

três décadas teve como principal objetivo reduzir a diferenciação entre seus cidadãos (ZHOU, 2000; WHYTE, 2010).

Em survey, na China, a respeito das atitudes sobre a desigualdade e injustiça distributiva, realizada em 2004 (entrevista com 3267 pessoas entre 18 e 70 anos), foi encontrada uma atitude geral de aceitação ou aprovação ao invés de raiva contra as desigualdades. Por exemplo, a maior parte dos respondentes disse que diferenças nas habilidades são um importante fator para explicar quem é rico (70%) e quem é pobre (61%), enquanto a injustiça do sistema econômico só foi expressa por 27% da população como justificativa de quem é rico e por 21% como justificativa de quem é pobre. Encontramos, inclusive, indicadores que demonstram não existir uma pauta em defesa da redistribuição de renda. Apenas 30% dos cidadãos respondentes disseram ser favoráveis a medidas redistributivas por parte do governo (WHYTE, 2010)[1].

Segundo o arcabouço proposto, o tema da desigualdade só será ativado politicamente a partir do momento em que os níveis de desigualdade econômica atingem patamares mais elevados, de forma a transformá-lo num tema sensível ao debate político e, portanto, um caminho para a obtenção de votos. Deste modo, solucionamos o enigma proposto por Gradstein e Milanovic (2004) sobre o crescimento da desigualdade econômica no Leste Europeu após o fim do sistema soviético e a posterior democratização. E resolvemos o problema incluin-

[1] Mesmo não havendo uma indisposição social contra o crescimento da desigualdade, os dados do Banco Mundial demonstram que o crescimento desta na China foi agudo nas três últimas décadas. Enquanto em 1981 o Índice de GINI chinês era de apenas 0.29, um dos menores do mundo, em 2002 esse número cresceu para 0.45, indicando que a China transitou de um país de baixa desigualdade para um país de desigualdade moderadamente alta.

do tal caso na análise e não adotando a solução mais utilizada pela literatura: a mera eliminação desses casos dos bancos de dados.

Assim, o tema da desigualdade econômica só virá à tona nos ambientes eleitorais em que uma considerável parcela dos eleitores for de fato sensível a essa temática. E isso ocorrerá quando a questão da desigualdade econômica for passível de ser traduzida em termos de injustiça e desequilíbrio social e não como consequência natural de outros elementos que sejam positivamente valorizados pelos cidadãos, como, por exemplo, a competição via mercado em contextos políticos nos quais os cidadãos tendem a valorizar os pontos positivos das relações mercantis centradas na livre iniciativa e no retorno monetário de acordo com a produtividade individual. Isto é, quando a distribuição de renda em uma dada sociedade for passível de abjeção social e existir espaço (verídico ou não) para a denúncia do uso das instituições políticas e econômicas para o benefício de certos grupos específicos em detrimento do todo social e não como consequências naturais de processos aceitos como justos pela sociedade.

O exemplo claro deste processo é a forte derrubada da desigualdade na América Latina nos anos 2000 com a consolidação das transições democráticas no subcontinente. Trata-se da região do mundo que após a terceira onda democrática associou em um mesmo território os índices mais altos de desigualdade no planeta com adoção de sistemas políticos democráticos e inclusive uma forte pressão da própria região para a manutenção dos regimes democráticos nos países que entraram em crise política, tal como os recentes exemplos paraguaio e hondurenho. Como demonstrado em Lustig, Lopez-Calva e Ortiz-Juarez (2013) nos anos 2000, após 15 anos de

democracia, há uma queda na magnitude da desigualdade latino americana não trivial. Este fenômeno abarcou países que apresentaram distintas características, como, por exemplo, altas taxas de crescimento na Argentina e outros que tiveram apenas um crescimento modesto como o México e Brasil ou mesmo que foram governados por partidos de centro-esquerda: Argentina, Brasil, Chile e Uruguai; ou por governos conservadores: México.

Postos tais elementos, nesta pesquisa temos como principal motivação revisitar essa hipótese tão disseminada no debate sobre o tema da relação entre desigualdade e democracia que tendem a tratar os efeitos da democracia como homogêneos ao longo da distribuição de desigualdade econômica. A razão para o uso tão generalizado deste suposto decorre de duas causas principais.

Do ponto de vista teórico a utilização do modelo do eleitor mediano como principal alicerce de reflexão a partir do qual são analisados como os padrões do comportamento político em sistema democrático são distintos dos padrões dos sistemas autoritários. Boa parte dos modelos teóricos se baseia no suposto de que existe uma dimensão única do debate político de determinada sociedade e a diferença entre as democracias e as ditaduras decorre do fato que o eleitor relevante da primeira é o eleitor mediano e o eleitor relevante da segunda é um membro da elite política e/ou econômica. O modelo formal elaborado por Buenos de Mesquita e outros (2005) é uma ilustração clássica e bastante disseminada desta opção teórica e o modelo redistributivo de Meltzer e Richard (1981) estabeleceu o *framework* básico a partir do qual são discutidas as diferenças entre democracia e ditadura no que se refere à redistribuição econômica.

Do ponto de vista empírico, a adoção do suposto de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são homogêneos decorre das exigências técnicas dos modelos tradicionais de regressão baseados em métodos lineares condicionais à média, incluindo os modelos lineares generalizados (GLM). Os modelos GLMs têm como objetivo principal a estimação de efeitos médios de um vetor de variáveis independentes em uma variável dependente. E para a estimação de efeitos heterogêneos é necessária a adoção de técnicas um pouco mais sofisticadas.

Desta maneira, refutamos empírica e teoricamente de maneira categórica a afirmação que a democracia tem o mesmo efeito sobre a desigualdade econômica em sociedades mais iguais ou em sociedades mais desiguais. Assim, propomos uma explicação alternativa na qual os efeitos da democracia sobre a desigualdade tendem a interagir com o próprio nível de desigualdade. Mais especificamente, propomos que as democracias que sobrevivem e se consolidam em sociedades mais desiguais tendem a ser mais eficazes no tratamento da desigualdade e o sucesso brasileiro em reduzir a profunda desigualdade econômica ao longo dos últimos 20 anos seria reflexo deste processo – o surgimento e consolidação da democracia em uma sociedade que atingiu níveis bastante elevados de desigualdade econômica.

Temos a expectativa que os efeitos da competição democrática sobre o tema da redistribuição em sociedades iguais não deve diferenciá-la de regimes não democráticos, uma vez que a desigualdade não é um tema a ser ativado pela disputa política. Inexiste a demanda por redistribuição na população e os partidos políticos não têm interesse em ativá-la, buscando obter apoio eleitoral por meio do uso de outras demandas políticas, ativando outras dimensões ou clivagens sociais. Por

outro lado, em sociedades excessivamente desiguais os partidos políticos tendem a moldar o discurso eleitoral e as próprias políticas públicas em busca da minimização dos efeitos da desigualdade econômica, uma vez que a demanda por redistribuição por parte da cidadania torna-se um vetor que diminui a importância de outras clivagens latentes que existam na sociedade. Os partidos políticos teriam uma maior tendência a atender a esta demanda e tratar do problema da desigualdade econômica como uma questão que excede os limites da economia de mercado, refletindo, outrossim, conceitos de injustiça e exploração social, e de denúncia do uso das instituições políticas e econômicas para benefício de certos grupos privilegiados.

O livro está organizado em 5 capítulos e mais as considerações finais. No primeiro capítulo revisamos a extensa literatura que trata da relação entre desigualdade e democracia tanto do ponto de vista teórico quanto empírico. Em primeiro lugar introduzimos o debate sobre a recorrente percepção nas Ciências Sociais de que a criação de iguais oportunidades e direitos políticos teria como consequência inevitável o fomento de melhores condições econômicas para as classes menos favorecidas, o que teria como implicação final a redução da desigualdade econômica vis-à-vis os resultados socioeconômicos de regimes políticos autoritários. Em seguida organizamos a literatura mais recente em torno de quatro mecanismos principais, por meio dos quais a democracia produziria seu efeito sobre a desigualdade. E, por fim, apresentamos os resultados da literatura empírica, sublinhando que até agora não há

o mesmo consenso empírico tal qual o teórico sobre os reais efeitos da democracia sobre a desigualdade.

Ainda no primeiro capítulo, apresentamos a literatura que trata das relações com democracia e com desigualdade de outras variáveis de confusão que afetam o modo com o qual a democracia e a desigualdade se relacionam. Estas são principalmente o papel exercido pela economia de mercado, que é concomitantemente associado a mais democracia e a mais desigualdade, o papel do desenvolvimento e dos choques tecnológicos e, por último, o papel da globalização e da expansão das relações comerciais e financeiras no mercado internacional. Finalmente, encerramos o capítulo discutindo brevemente a literatura que analisa a relação inversa entre democracia e desigualdade: o aumento da desigualdade pode reduzir ou aumentar a probabilidade de um regime autoritário tornar-se democrático e de um regime democrático permanecer neste estado ao longo dos anos.

No segundo capítulo desenvolvemos o argumento teórico de que os efeitos da desigualdade são heterogêneos ao longo da própria distribuição de desigualdade econômica entre os países, de forma que para estimar o efeito real da democracia é necessário separar como o sistema político age em relação à desigualdade em sociedades mais iguais, em sociedades intermediariamente desiguais e nas sociedades mais desiguais. O nosso argumento é que a democracia só irá reduzir a desigualdade nas sociedades que são mais desiguais, pois nessa existem incentivos para o surgimento de uma demanda por políticas redistributivas no seio do eleitorado e também os partidos políticos encontram incentivos positivos para atenderem a esta demanda. Os pormenores do argumento e as respectivas hipóteses são detalhados no capítulo.

No mesmo capítulo discutimos a metodologia adequada para estimar os efeitos heterogêneos da desigualdade e ao mesmo tempo controlar o problema da potencial causalidade inversa que existe na relação entre democracia e desigualdade. Para tal empreitada combinamos duas metodologias distintas. Para estimar os efeitos heterogêneos da desigualdade adotamos o *framework* da regressão quantílica, enquanto para estimarmos a relação da democracia sobre a desigualdade independente da relação da desigualdade sobre a democracia optamos pelo método de variável instrumental. As condições necessárias para o uso de cada um dos métodos são descritas no Capítulo 2 e os testes que comprovam a validade das variáveis instrumentais selecionadas são apresentados no Capítulo 4.

No terceiro capítulo discutimos, em seus pormenores, o que entendemos por democracia e desigualdade econômica e como mensuramos estes dois fenômenos. É importante a discussão conceitual sobre as duas variáveis, pois existe uma vasta literatura e inclusive um debate acirrado sobre quais são as definições mais adequadas na conceptualização de cada um dos conceitos e qual é a melhor forma de mensurá-los. Optamos nesta pesquisa por adotar o coeficiente de GINI como a régua de mensuração da escala, pois além de ser o mais difundido na literatura é também sensível a alterações na distribuição de renda no começo, meio ou final da distribuição. E em relação à democracia optamos por uma interpretação minimalista do fenômeno democrático, entendendo apenas como a existência de competição política pelo poder associado à participação de toda a população adulta e adotamos a medida de democracia que é adequada a esta definição e cuja confiabilidade é maior.

Sublinhamos que nos abstemos de qualquer discussão mais profunda a respeito de qual seja o conteúdo adequado do

termo democracia. Caso o leitor considere a definição minimalista excessivamente pouco exigente, a nossa pesquisa tenta estimar o impacto que a competição política livre e aberta tem sobre a desigualdade econômica. Isto porque o mecanismo por meio do qual a democracia teria efeitos heterogêneos sobre a desigualdade decorre da natureza competitiva da disputa política democrática e como os partidos e os eleitores encaram o problema da desigualdade como trunfo e/ou determinante da escolha do voto.

Finalizamos o capítulo apresentando a relação descritiva da evolução da desigualdade entre democracias e ditaduras ao longo de dois diferentes períodos de tempo. No primeiro analisamos a relação utilizando dados mais refinados de democracia e desigualdade entre 1960 e 2008 e depois analisamos com dados um pouco mais problemáticos, mas que abrangem todo o vasto período de surgimento dos regimes representativos democráticos, tanto nos países do mundo desenvolvido e do mundo em desenvolvimento – entre 1820 e 1992. As principais conclusões que emergem de ambas as análises são, em primeiro lugar, a constatação de que os últimos anos são marcados por um abrupto crescimento da desigualdade não encontra respaldo nos dados e, em segundo lugar, a democracia não parece ter um comportamento médio distinto do comportamento das ditaduras sobre a desigualdade. E, por fim, na última seção do capítulo apresentamos a descrição das variáveis de confusão que serão utilizadas como controles no capítulo 4.

No capítulo 4 apresentamos a análise inferencial do argumento. Apresentamos evidências de que as variáveis instrumentais escolhidas identificam adequadamente a variável endógena democracia, de modo a tornar possível a estimação dos reais efeitos da democracia sobre a desigualdade

econômica. Os testes realizados demonstram de maneira clara que os instrumentos selecionados – instrumentos relacionados ao fenômeno da difusão de democracia pelo mundo e da localização longitudinal de um país – são correlacionados com democracia e não correlacionados com desigualdade.

No capítulo 5, ainda fazemos uma bateria de análises utilizando diferentes medidas de democracia e desigualdade, diversas especificações do modelo final, inclusive outros bancos de dados e comprovamos a hipótese de que a democracia possui efeitos heterogêneos sobre a desigualdade e que os efeitos em direção à redução da desigualdade estão concentrados nos países mais desiguais. Além do mais, apresentamos evidências contundentes que a estimação dos efeitos médios da democracia sobre a desigualdade por meio de métodos condicionais à média é extremamente inadequada, uma vez que, dependendo da variação dos efeitos heterogêneos, a sumarização pode ser positiva, negativa ou nula.

Tais resultados indicam de maneira peremptória que a hipótese tradicional adotada pela literatura de que a democracia afeta a desigualdade econômica de maneira homogênea em países iguais, medianamente desiguais e muito desiguais é equivocada, um impedimento forte para a evolução do debate a respeito da relação entre a democracia e a desigualdade econômica e a principal causa por detrás das inconsistências empíricas encontradas na própria literatura.

O campo teórico da discussão entre democracia e desigualdade

A promoção da democracia pelo mundo tornou-se uma característica marcante da agenda política internacional por vários motivos, destacando-se a suposta propensão da democracia em reduzir as disparidades econômicas entre os indivíduos de uma mesma comunidade política (TIMMONS, 2010). A noção de que a equidade política reduz as disparidades econômicas está profundamente enraizada nas ciências sociais (BOLLEN; JACKMAN, 1985). Desta forma, dada a proliferação de governos representativos e a grande disparidade de renda existente entre e dentro dos países, a relação entre democracia e desigualdade econômica tem significado prático e acadêmico imenso.

Boa parte das teorias em que as eleições democráticas importam baseia-se na suposição de que as democracias são qualitativamente diferentes de não democracias, especialmente no que se refere à distribuição e redistribuição de recursos e status entre os indivíduos. Esta conexão entre instituições políticas e redistribuição tem suas raízes no pensamento clássico de Aristóteles (2005), Maquiavel (1979) e John Stuart Mill (1862). Para o pensador grego em *A política* (2005): "nas democracias os pobres possuem maior poder soberano que os

homens de propriedade: pois eles são mais numerosos e a decisão da maioria prevalece" (MILL, 1861; MAQUIAVEL, 1979; ARISTOTELES, 2005).

O ponto de partida desta pesquisa é discutir se a democracia, por intermédio da criação de condições políticas iguais, contribui para a edificação de maior equidade econômica. De fato, durante o século XIX, a equidade política e a equidade econômica conectavam-se tal qual um silogismo social. O sufrágio universal combinado com a regra majoritária concederia poder político para a maioria e devido ao fato de que a maioria é sempre pobre, ela adquiriria as condições políticas necessárias para confiscar a riqueza dos ricos e compartilhá-la com todos na sociedade, incluindo aqui o próprio fim do direito à propriedade privada (PRZEWORSKI, 2010).

Na visão de Gerring, Thacker e Alfaro (2012), a hipótese de que as instituições democráticas promovem uma dinâmica política favorável às necessidades e interesses dos menos favorecidos tornou-se um axioma teórico fundamental na comparação entre democracias e ditaduras. Gerhard Lenski (1966) afirma inclusive que a retórica da democracia se baseia na ideia de que existe uma redistribuição de poder em favor dos desfavorecidos, a maioria em qualquer sociedade. A ideologia democrática legitimaria a redistribuição do poder em favor dessa maioria desfavorecida. E com este aumento da igualdade política, medidas em favor de uma maior igualdade social e uma distribuição mais igualitária de bens seriam inevitavelmente introduzidas.

Adam Przeworski (2010) entende que esta previsão foi um tema central do debate e dos conflitos políticos em torno da expansão do sufrágio universal e da consolidação da democracia como forma de governo nos países ocidentais. Tal conexão entre a expansão democrática por meio do sufrágio universal e o fim da propriedade fora levantada e debatida tanto

por intelectuais conservadores quanto por socialistas. Grupos conservadores se opuseram à expansão dos direitos políticos ao longo da história, temendo as consequências distributivas do novo regime que poderiam minar a favorável posição econômica dos privilegiados (BOLLEN; JACKMAN, 1985)

Na visão do economista David Ricardo para evitar a ameaça democrática à liberdade, a extensão do sufrágio deveria estar limitada apenas para aqueles cidadãos que não possuem interesse em eliminar o direito à propriedade privada. Thomas Macaulay em seu discurso sobre o movimento cartista em 1842 vislumbrou a expansão do sufrágio como "o fim da propriedade e assim de toda a civilização" (PRZEWORSKI, 2011). Na outra ponta do espectro ideológico, Karl Marx (1972) expressou forte convicção de que a propriedade privada e o sufrágio universal eram inerentemente incompatíveis, conforme explicitado em estudo sobre os conflitos de classe na França entre 1848 e 1850:

> A ampla contradição desta Constituição consiste, porém, no seguinte: As classes cuja escravidão social deve eternizar: proletariado, camponeses, pequenos burgueses, ela coloca-as na posse do poder político por meio do sufrágio universal. E a classe cujo velho poder social sanciona, a burguesia, ela retira-lhe as garantias políticas desse poder. Comprime a sua dominação política em condições democráticas que a todo o momento favorecem a vitória das classes inimigas e põem em causa os próprios fundamentos da sociedade burguesa. A umas, exige que não avancem da emancipação política para a social, às outras, que não retrocedam da restauração social para a política. (KARL MARX, 1849)[2].

---

[2] *As lutas de classes em França de 1848 a 1850*, Parte II, de junho de 1848 a 13 de junho de 1849 (MARX, 1972).

Na visão do intelectual socialista, a democracia inevitavelmente abriria uma enorme fronte de conflito entre as classes sociais ao deslocar o poder político das elites aristocráticas para a maioria. Assim podemos concluir que às vésperas da revolução democrática do século XX, em todos os espectros do debate político, existia uma forte percepção de que as relações entre democracia, capitalismo e propriedade privada, e, sobretudo, as relações entre democracia e desigualdade econômica seriam inerentemente instáveis.

A crença na relação negativa entre democracia e desigualdade tem sido uma das principais razões pelas quais os movimentos políticos reformistas têm procurado garantir os direitos políticos para os grupos que estão fora da cidadania[3]. Lipset (1959) argumentou que as estruturas políticas democráticas promovem eleições que servem como a expressão da luta de classe democrática, pois os cidadãos tendem a votar em partidos que concorrem primordialmente pela representação dos interesses das classes médias e trabalhadoras. A extensão do sufrágio àqueles que não possuíam propriedades e/ou riqueza tenderia, portanto, a aumentar a competição política em sociedades industriais, movendo o debate e a disputa para a esquerda do espectro político (LENSKI, 1966; GRADSTEIN; MILANOVIC, 2004).

Outros têm argumentado que a democracia aumenta as oportunidades de participação, permitindo que os pobres

---

[3] O impacto negativo da democracia sobre a desigualdade econômica é definido do ponto de vista estatístico, o que significa que a democracia e a desigualdade variam inversamente: isto é, quanto maior uma, menor a outra. Os termos impactos positivos e negativos serão sempre utilizados segundo este prisma de covariação estatística e nunca segundo um ponto de vista normativo, no qual o efeito da democracia seria bom (positivo) quando reduzisse a desigualdade econômica.

possam exigir uma redistribuição de renda mais equitativa. Isto porque com a expansão do sufrágio, os líderes democráticos em busca da reeleição de seu grupo no poder são responsabilizados perante os eleitores e sintonizam-se cada vez mais com as suas necessidades, facilitando a eleição de representantes de partidos trabalhistas ou sociais democráticos (CHAN, 1997). Diante disso, governos democráticos tornar-se-iam mais inclinados a ajudar as classes pobres e médias por meio da adoção de políticas redistributivas como gastos com bem-estar social, políticas tributárias progressivas, fixação de salário mínimo e preços subsidiados, entre outros. (RODRIK, 1998a).

Os efeitos dos regimes autoritários em fomentar o crescimento da desigualdade também explicariam parte dos benefícios trazidos pela democracia. Os líderes autoritários ao ser responsabilizados perante apenas uma minoria rica e poderosa[4], tendem a adotar políticas públicas que beneficiem estritamente essa minoria, mantendo ou aumentando a desigualdade econômica. E a própria análise dos benefícios da competição política democrática é realizada em comparação com os resultados produzidos vis-à-vis aos *outputs* dos regimes não democráticos, sendo estes tomados com um conjunto definido pela negação – a ausência de competição política democrática[5]; e não por alguma característica semelhante a todos[6].

---

[4] Não importando ao argumento se os detentores do poder são ricos antes de assumirem a posição de autoridade ou se amealham mais recursos econômicos em movimento posterior à obtenção do poder político.

[5] Como esclarecemos mais a frente, assumimos a definição minimalista de democracia adotada por Przeworski, Alvarez, Cheibub e Limongi (2000), na qual é o regime em que partidos competem pelo poder político em eleições abertas, livres e justas, com incerteza *ex-ante* e certeza *ex-post* acerca dos resultados eleitorais.

[6] Um tema que não é debatido nessa pesquisa, mas que é de fundamental importância para análise da relação entre regime político e desigualdade é o estudo

Especificamente, se argumenta que regimes autoritários conseguem com mais facilidade adotar políticas que beneficiem uma minoria à custa da maioria excluída da comunidade política, devido ao fato que não existe nenhum mecanismo político a partir do qual seja possível responsabilizar o poder político à maioria. Evans (1995) e Kaufman (1979), por exemplo, sugerem que regimes autoritários tem mais liberdade em colaborar com corporações sediadas no exterior para promover um setor moderno pequeno e bem remunerado à custa do setor econômico tradicional, maior e mais pobre. Tais padrões implicam que os regimes não democráticos tenderiam a gerar mais desigualdade em favor das elites econômicas e em detrimento dos camponeses e trabalhadores. Este resultado parece típico se olharmos as consequências distributivas de regimes autoritários modernizantes como os encontrados durante o período militar brasileiro e chileno ou mesmo o regime iraniano do Xá Reza Pahlevi.

Neste capítulo apresentamos as diferentes contribuições da literatura em economia política comparada sobre a relação entre democracia e desigualdade. Na primeira seção organizamos a literatura segundo os diferentes mecanismos a partir dos quais a democracia impacta negativamente na desigualdade econômica. A seguir realizamos um breve balanço da literatura empírica, na qual até agora não há consenso se a relação é positiva, negativa ou nula.

---

de como diferentes institucionalidades e tipos de lideranças autoritárias afetam a desigualdade econômica de uma determinada comunidade política. Em nossa pesquisa assumimos que ditadura é todo e qualquer regime que não é democrático, mas não examinamos os efeitos que diferentes configurações institucionais autoritárias possuem sobre a desigualdade e qual é a performance da democracia em comparação a esses diferentes tipos de regimes ditatoriais. Para uma análise sofisticada das variações institucionais entre os regimes autoritários ver (SVOLIK, 2012).

Na terceira, quarta seção apresentamos sucintamente a literatura sobre alguns determinantes da desigualdade econômica que são potenciais fatores de confusão na relação entre democracia e desigualdade, tais como o próprio processo de desenvolvimento econômico e tecnológico. Além disso, uma influência relevante é o papel da expansão das relações de mercado, acentuadas ainda mais no pós Guerra Fria com a crescente globalização econômica e a aceleração dos fluxos internacionais de comércio e finanças. Isto porque existe uma associação forte entre a expansão dos sistemas democráticos e a expansão de mercados e, de acordo com análises empíricas recentes, o livre mercado tem efeito direto no aumento da desigualdade econômica, pois os indivíduos são dotados de diferentes conjuntos de bens, habilidades e recursos, remunerados a taxas distintas (PRZEWORSKI, 2010; PIKETTY, 2014).

Na quinta seção tratamos da potencial relação causal inversa entre democracia e desigualdade. Após um vasto esforço de se entender os efeitos do desenvolvimento econômico sobre os processos de democratização, a literatura comparada se interessou por como a distribuição de recursos dentro de uma dada sociedade pode afetar as possibilidades de um regime autoritário adotar instituições democráticas e de um regime democrático reproduzir-se ao longo do tempo (ANSELL; SAMUELS, 2014). Por fim, concluímos o capítulo e introduzimos os temas do próximo.

1.1 O debate sobre a relação entre democracia e desigualdade

A literatura sobre efeitos da democracia na mitigação do problema da desigualdade econômica formulou quatro mecanismos gerais por meio dos quais os regimes democráticos

exercem uma pressão em direção a uma maior equidade econômica (TIMMONS, 2010; GERRING; THACKER; ALFARO, 2012).

O primeiro mecanismo é baseado na **relação entre os sistemas de tributação e transferências de renda** que decorre de postulações teóricas tomadas à luz do teorema do eleitor mediano de Harold Hotelling e Anthony Downs. No texto clássico de Meltzer e Richard (1981) o ponto de equilíbrio do tamanho do governo é modelado como consequência da regra majoritária e da distribuição de produtividade na economia[7] (HOTELLING, 1929; DOWNS, 1957). A extensão dos direitos de sufrágio, a posição do eleitor mediano, cuja preferência determina as políticas governamentais, é deslocada para baixo na distribuição de renda. Em condições de sufrágio universal, o eleitor mediano tende a ter renda idêntica à renda mediana. E como está é inferior à renda média, ele favorece uma política tributária distributiva e progressiva, transferindo renda das elites para os menos favorecidos.

Os modelos de economia política que partem do arcabouço de Meltzer e Richard invariavelmente afirmam que quanto maior a desigualdade econômica – isto é: uma distância maior entre as rendas médias e mediana – maior a taxa de redistribuição por meio da ação eleitoral e política do governo democrático. A teoria é sintetizada na ideia de quanto maior for a distância entre a renda do eleitor mediano e a renda média da população, maior será a tendência de o governo redistribuir renda do topo para a base, reduzindo o escopo

[7] Os modelos do eleitor mediano sobre a redistribuição (ROMER, 1975; ROBERTS, 1977; MELTZER; RICHARD, 1981) são o ponto de partida para grande parte da discussão sobre a economia política do Estado de Bem-Estar Social.

da desigualdade econômica[8]. De forma simplificada, como as democracias levam às urnas uma parcela majoritária de indivíduos que possuem renda inferior à média, essa maioria, atuando coletivamente, força o governo a redistribuir renda da elite para as massas.

O modelo redistributivo de Meltzer e Richard assume que o governo tributa uma porcentagem específica e uniforme da renda dos indivíduos e, a partir da arrecadação obtida, distribui um benefício universal e de igual valor para todos. Assim são criados incentivos para a redistribuição, quaisquer que sejam as regras de votação que concentrem votos abaixo da renda média, uma vez que a distribuição de renda é quase sempre desviada para a esquerda. E como nos modelos redistributivos a distribuição da renda bruta[9] é exógena ao sistema político, a redução da desigualdade é simplesmente assumida como o estreitamento da distância entre a renda individual e a renda média para todos os grupos de renda.

Bergh (2005) critica essa forte suposição do modelo redistributivo, uma vez que ela implica que as políticas públicas redistributivas não afetam a oferta de trabalho. Caso exista um efeito das políticas redistributivas sobre o trabalho ofertado, é necessário levar em conta o impacto posterior da política

---

[8] Meltzer e Richard (1981) usam a parcela de renda distribuída pelo governo em dinheiro e em serviços como uma medida do tamanho relativo do governo e desenvolvem uma teoria no qual o tamanho do governo é definido por escolhas racionais de indivíduos maximizadores de utilidade que são completamente informados sobre o presente estado da economia e das consequências da taxação e da redistribuição de renda (MELTZER; RICHARD, 1981).

[9] A distribuição de renda bruta é definida pela renda dos indivíduos antes de impostos e transferências: a distribuição da renda obtida pelos indivíduos em situação de mercado. Já a distribuição de renda líquida é definida pela renda dos indivíduos após a tributação e transferências públicas.

redistributiva na distribuição de renda pré-tributação – a renda bruta, tornando-a endógena ao modelo redistributivo. Na visão de Bergh, os diferentes grupos da sociedade devem responder de maneira distinta à oferta de benefícios públicos, o que pode ocasionar tanto aumento quanto diminuição da desigualdade bruta. Por exemplo, indivíduos mais jovens tendem a reduzir a sua oferta de trabalho se existem recursos públicos para serem investidos em sua própria educação, enquanto mulheres tendem a reduzi-la para dedicar mais tempo à educação e criação de seus filhos, e, por fim, idosos tendem a se retirar mais facilmente do mercado por razões de saúde (NICAISE, 1998; BERGH, 2005).

Boix (2010) argumenta na mesma linha ao analisar que na escolha de políticas públicas que beneficiam o eleitor mediano, é necessário levar em conta não apenas o impacto direto da ação pública na renda líquida desse indivíduo (BOIX, 2010). Um arcabouço regulatório molda a renda bruta de todos os indivíduos. Desta forma, ao se calcular as consequências de determinado arcabouço institucional é necessário o cálculo da mudança final da renda do eleitor mediano, levando em conta os efeitos da tributação, da oferta de trabalho e os custos da participação política[10]. Robinson (2009) por sua vez sublinha que não existe a possibilidade de uma distribuição de renda de

[10] Outra possível consequência é o impacto de gastos com educação na capacidade de engrandecimento do capital humano individual. Isto porque se a distribuição de capital humano for desigual, o aumento do gasto público em educação tende a reduzir essa desigualdade, endogenizando, por meio de outro mecanismo, a distribuição de renda pré-tributação (BERGH, 2005). Usando dados sobre gastos governamentais em educação, Sylwester (2002) mostrou que países que destinaram maior parte do seu PIB para a educação pública experienciaram menor desigualdade nos anos subsequentes (SYLWESTER, 2002; BERGH, 2005).

mercado tal como ela fosse livre de quaisquer influências do mundo da política. A própria ideia de mercado é em parte uma construção política (PRZEWORSKI, 2003). Para existir o livre mercado capitalista é necessária a construção institucional dos direitos de propriedade e das próprias esferas de mercado, que só são garantidos a partir da ação política do próprio estado, pois é o sistema político quem determina a natureza destes direitos de propriedade e o quão livre estão os agentes econômicos para operarem dentro de determinadas estruturas de trocas.

Não obstante, mesmo que os regimes políticos reais não se encaixem perfeitamente na estrutura teórica do modelo do eleitor mediano, as conclusões gerais do modelo implicam que de alguma forma as democracias devem apresentar sistematicamente um nível inferior de desigualdade do que as não democracias, ainda que a relação entre a diferença da renda do eleitor mediano com a renda média e a taxa de redistribuição não seja perfeitamente monotônica e nem as predições do modelo sejam passiveis de aceitação teórico-formal (ACEMOGLU; ROBINSON, 2006).

Ademais, estudos quantitativos recentes mostram que as democracias tendem a produzir maior quantidade de bens e serviços públicos e mais redistribuição de renda que ditaduras. (AVELINO; BROWN; HUNTER, 2005; ROSS, 2006; GERRING; THACKER; ALFARO, 2012). Estudos históricos também mostram uma correlação entre a extensão do sufrágio e o tamanho do governo nos EUA, Europa e América Latina (KRISTOV; LINDERT; MCCLELLAND, 1992; LINDERT, 1994; GOUVEIA; MASIA, 1998). Bueno de Mesquita et al. (2005) são incisivos ao elaborarem um modelo sobre a sobrevivência das lideranças políticas, no qual quanto maior for a

participação para a escolha do governo (*selectorate*) e a base de apoio deste governo (*winning coalition*), maiores serão os incentivos para a produção de bens públicos[11].

O segundo mecanismo é a **competição política e o papel desempenhado pelo voto retrospectivo e prospectivo**, que sublinha a conexão eleitoral entre o eleitor e as lideranças políticas e a responsividade engendrada pelo ordenamento político democrático (KEY, 1949). O arcabouço básico do mecanismo de competição política se fundamenta no argumento de que quanto mais os líderes políticos competem entre si e em grupos organizados pelo apoio dos cidadãos, mais serviços são produzidos pelo setor público para dado nível de arrecadação do governo. E devido ao fato que a democracia está intimamente relacionada com a existência de competição política, a melhora dos serviços prestados pelo governo é estimulada.

Na visão de Gerring, Thacker e Alfaro (2012), como a miséria generalizada é impopular, líderes democraticamente eleitos são mais cuidadosos com problemas referentes ao desenvolvimento humano. Um exemplo disto é a constatação de Sen e Dreze (1989) de que até hoje nunca foram registradas crises humanitárias em regimes democráticos. Sen (1983; 1999) argumenta que em democracias, por meio do processo eleitoral, os pobres podem penalizar os governos que permitem o desenvolvimento de crises humanitárias:

> A fome mata milhões de pessoas em diferentes países do mundo, mas nunca mata os governantes... se não houver eleições, sem partidos de oposição, sem espaço

[11] Outra forma de interpretação dos resultados de Bueno de Mesquita et al. (2005) sugere que os governos democráticos têm uma gama mais ampla de apoiadores para atender, que os induz à produção de mais bens públicos em comparação a bens privados.

> para críticas públicas não censuradas, então aqueles que possuem autoridades não irão sofrer as consequências políticas no fracasso em evitar crises de fome. As democracias, por outro lado, estenderiam os efeitos negativos da fome para os grupos dominantes e os líderes políticos. (SEN, 1999)[12].

Valdimer O. Key (1949), por sua vez, conecta explicitamente a relação entre democracia e desigualdade à competição política. Ao analisar o sistema de partido único dos estados do sul dos EUA, ele conclui que a organização política unipartidária impede o debate organizado sobre temas e, ao contrário, leva o debate político a uma disputa de personalidades. As instituições democráticas seriam fundamentais ao darem origem a competição política organizada. A falta de concorrência sustentada entre dois grupos políticos claramente definidos tornaria o governo mais suscetível a pressões individuais e favoritismo, impedindo o debate sobre temas abrangentes. Isto posto, Key conclui que os sistemas de partido único têm um viés pró-*status quo* que beneficia as elites privilegiadas em detrimento dos pobres. Sem a competição política entre partidos organizados, os pobres não possuiriam nenhum mecanismo que possibilitasse a sua participação política efetiva nas decisões do Estado.

Além disso, com uma distribuição mais equitativa de poder, a democracia dá mais espaço para que os sindicatos de trabalhadores e partidos políticos representem as classes sociais fora do restrito círculo das elites, assim como estimula a criação de políticas públicas para competir pelo voto das bases

[12] Todas as citações de trabalhos em língua estrangeira foram traduzidas livremente.

sociais desses sindicatos e de partidos não elitizados. Quanto mais organizados e vitais estes grupos forem, maior será o seu sucesso na busca por influência no processo decisório partidário. E caso os grupos de menor renda se beneficiem mais das atividades governamentais, especialmente da educação pública, a democracia tenderá a reduzir a dispersão de capital humano na sociedade, causando, no longo prazo, a queda da desigualdade (SAINT-PAUL; VERDIER, 1993).

Por fim, Sen (1999) argumenta que a democracia permite que um maior fluxo de informação seja transmitido das áreas mais pobres e remotas para o governo central devido ao trabalho da livre imprensa e do uso e divulgação estratégica de informações por aqueles que buscam ocupar e competem pelo centro do sistema político. Assim, quando existe a possibilidade de surgimento de uma crise falimentar, a mídia e opositores têm incentivos políticos e institucionais para trazer à tona fatos que sejam negativos para o governo e que usualmente seriam censurados em ditaduras.

O terceiro mecanismo que indica a tendência da democracia ser mais efetiva na redução da desigualdade econômica é **a presença de uma sociedade civil mais institucionalizada e desenvolvida**, uma vez que os direitos políticos e os direitos civis são altamente correlacionados. A existência de direitos civis estimula, no decorrer do tempo, a criação de uma rede densa de associações voluntárias que prestam serviços aos desfavorecidos, muitas vezes em conjunção com entidades governamentais, que também tendem a influenciar as atividades legislativas por meio de pressão política e atividades de lobby (GERRING; THACKER; ALFARO, 2012). Para Simon Kuznets (1955):

> O crescimento do poder político dos grupos urbanos de menor renda leva a uma variedade de leis de proteção e

> apoio, muitas das quais buscam combater os piores efeitos da rápida industrialização e urbanização e apoiar as reivindicações das grandes massas para uma participação maior na renda crescente do país. (KUZNETS, 1955).

A provisão dos benefícios oriundos dos serviços do Estado de bem-estar social demandados por essas organizações representaria um importante meio pelo qual o governo poderia influenciar a desigualdade (RUEDA, 2008). Esses serviços, além de redistribuírem riqueza para os pobres, também minimizam os riscos do mercado de trabalho (MOENE; WALLERSTEIN, 2003). Assim, existem duas formas nas quais os gastos do governo podem afetar a desigualdade. Primeiro, reduzindo os riscos dos trabalhadores, pois os programas de bem-estar têm como consequência imediata reduzir a dependência das pessoas à participação no mercado de trabalho como fonte de riqueza (ESPING-ANDERSEN, 1991). Segundo, Iversen e Cusack (2000) apontam que os serviços providos pelo governo reduzem a desigualdade no acesso à educação e saúde, além de ampliarem o escopo do emprego público, que também pode ser utilizado como mecanismo de redução da variação salarial.

Por fim, o quarto e último mecanismo enfatiza explicitamente as consequências da democracia na **regulação do mercado de trabalho**. Como notado por Schumpeter (2013), a democracia reduz o custo de participação política do trabalho organizado, permitindo que obtenha uma posição mais privilegiada no processo político. Rodrik (1998a) revisitou o argumento defendendo que as democracias se caracterizam por atributos que capacitam trabalhadores na medida em que incentiva a sindicalização, a negociação salarial centralizada e

a existência de salários mínimos, o que reduz a desigualdade de rendimentos. Scheve e Stasavage (2009) mostraram que a densidade sindical (porcentagem de membros da população economicamente ativa que estão em sindicatos) e a concentração das negociações salariais estão negativamente correlacionadas com a desigualdade econômica.

Wallerstein (1999) analisa a desigualdade nos salários entre 16 economias avançadas e encontra fortes evidências de que a centralização do processo de negociação salarial é forte redutor das disparidades de rendimentos. Outros fatores importantes também são a própria concentração de poder dos sindicatos e a parcela da força de trabalho coberta por acordos de barganhas salariais coletivas. Para Wallerstein, a associação entre a centralização do processo de negociação salarial e uma distribuição mais equitativa de ganhos decorreria do fato que a centralização altera a influência de diferentes grupos no processo de definição salarial ao comprimir a estrutura dos salários e, assim, indiretamente, reduzir a desigualdade de ganhos. Ademais, se os trabalhadores mais produtivos optarem por sair do acordo central, o efeito da centralização será intensificado na calda final da distribuição de renda, afetando negativamente a desigualdade (WALLERSTEIN; GOLDEN; LANGE, 1997).

Rueda (2008) demonstra que o corporativismo é uma variável que afeta a capacidade dos partidos políticos em produzir políticas que reduzam a desigualdade, sobretudo no que toca à variação salarial. De acordo com o autor, em sistemas corporativos os partidos políticos não possuem graus de liberdade para afetar a desigualdade salarial. Apenas nos países cujo nível de coordenação na barganha entre empregadores e empregado é baixa é que a política partidária consegue afetar a desigualdade econômica por meio do estabelecimento de sa-

lários mínimos maiores, gastos do governo com o estado de bem-estar social e no financiamento do estado por meio de impostos sobre o trabalho.

Finalmente, vale a pena mencionar como último ponto as relações teóricas entre democracia e desigualdade. Alguns autores propõem que esta relação não é encontrada em curto, mas sim em longo prazo. As estruturas institucionais de maior dispersão do poder político nas democracias demoram para afetar as estruturas de concentração – difusão dos recursos econômicos. Deste modo, apenas ao longo de uma extensa trajetória democrática que a desigualdade econômica entre os cidadãos tende a ser arrefecida. Sirowy e Inkeles (1990) e Gradstein e Milanovic (2004) ao reverem a literatura empírica que trata sobre o tema concluem que os resultados mais robustos são aqueles que analisam o tamanho da experiência democrática com a desigualdade econômica. Muller (1988) reporta que aproximadamente 20 anos de experiência democrática são necessários para os efeitos igualitários da distribuição do poder político atingirem e arrefecerem a concentração do poder econômico[13].

1.2 Resultados empíricos

Apesar desse já extenso e já bem desenvolvido arcabouço teórico que integra ao regime político democrático uma

[13] Ainda que não estejam preocupados na análise entre a relação da democracia com a desigualdade econômica e sim com os efeitos das instituições de trabalho, instituições eleitorais e da ideologia política dos partidos, o trabalho de Scheve e Stasavage (2009) deixa claro a importância de se analisar os efeitos de longo prazo das instituições sobre a desigualdade econômica, uma vez que em curto prazo as mudanças institucionais tendem a ser menores e a dinâmica da desigualdade tende a reagir lentamente aos eventos do mundo da política.

dinâmica de redução de desigualdade econômica, os achados empíricos não são robustos e surpreendem o leitor. Na visão de Timmons (2010), este enorme descompasso existente entre as teorias que vislumbram um potencial democrático em reduzir as desigualdades econômicas e as evidências empíricas pode ser parcialmente atribuído à escassez de dados confiáveis sobre a mensuração da desigualdade econômica[14], sem contar os enormes problemas conceituais relacionados à que tipo de desigualdade econômica a democracia opera para reduzir: a desigualdade de consumo, a desigualdade de ganhos ou mesmo a desigualdade da capacidade de se obter renda econômica.

Em uma extensa revisão dos primeiros esforços da literatura quantitativa em estimar o efeito da democracia sobre a desigualdade, Sirowy e Inkeles (1990) analisaram doze diferentes estudos. Entre estes, sete estudos[15] acharam efeitos da democracia em direção à redução da desigualdade econômica, enquanto outros cinco[16] mostraram que esses efeitos são positivos, porém estatisticamente insignificantes. Contudo, alguns achados devem ser qualificados. Em Cutright (1967) os efeitos são encontrados apenas nas economias médias e pobres, enquanto não há efeitos entre as economias mais ricas. Hewitt (1977), por sua vez, argumenta que os efeitos do regime político democrático são de fato efeitos espúrios e causados primordialmente pelas sociais democracias. Por fim, Muller (1988)

[14] No capítulo 3 apresentamos de maneira mais detalhada as dificuldades e soluções para a mensuração do fenômeno da desigualdade econômica.
[15] Cutright (1967); Hewitt (1977); Stack (1979; 1980); Weede e Tiefenbach (1981); Weede (1982); Muller (1988).
[16] Jackman (1975); Rubinson e Quinlan (1977); Bollen e Grandjean (1981); Kohli et al. (1984); Bollen e Jackman (1985).

encontra evidências de que é a extensão da experiência democrática e não o nível de democracia que reduz a desigualdade.

Por sua vez, Rubinson e Quinlan (1977) controlam as estimações para o problema da causalidade reversa usando um sistema de equações da múltipla relação entre democracia e desigualdade e encontram um efeito da desigualdade sobre a democracia, mas não da democracia sobre a desigualdade. Já Bollen e Jackman (1985) reexaminam a análise de Rubinson e Quinlan e não encontram efeitos significantes em nenhuma das direções causais. Assim, Sirowy e Inkeles concluíram que é ambígua a evidência de que a democracia reduz a desigualdade econômica, ainda que a medida da extensão da experiência democrática parece contribuir mais diretamente com a equalização das relações econômicas.

Resultados mais otimistas, ainda que cautelosos, foram encontrados na revisão da literatura elaborada por Gradstein e Milanovic (2004). A revisão levantou alguns estudos históricos que encontraram forte associação entre a extensão do sufrágio, sobretudo o direito de voto às mulheres, com um aumento do gasto público redistributivo nos EUA, Inglaterra e Suíça, (HUSTED e KENNY, 1997; ABRAMS; SETTLE, 1999; JUSTMAN; GRADSTEIN, 1999; LOTT JR; KENNY, 1999), enquanto Mueller e Stratmann (2003) encontraram evidências de que quanto maior o *turnout* eleitoral, maior é a redução da desigualdade.

Assim como Bollen e Jackman (1985), Gasiorowski (1997) e Lundberg e Squire (1999) reportaram que os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica são estatisticamente insignificantes[17], enquanto Muller (1988), Moon

[17] Lundberg e Squire (1999) encontraram um efeito protetor da democracia em

(1991) e Rodrik (1998a) sustentaram que a democracia de fato reduz a desigualdade, ainda que os potenciais mecanismos causais fossem distintos. Chan (1997), por sua vez, reportou resultados mistos, analisando os efeitos da democracia sobre diferentes tipos de gastos públicos redistributivos[18], enquanto Simpson (1990) e Justman e Gradstein (1999) argumentaram, utilizando uma mensuração contínua de democracia, que a desigualdade de renda aumenta com a democracia até certo nível de democracia, após o qual os efeitos começam a declinar, numa espécie de curva política de Kuznets. Por fim, Nielsen e Anderson (1995) também propuseram uma relação num formato U-invertido, mesmo que seus achados não se mostrem robustos à inclusão de novos controles.

Um dos principais problemas enfrentados nesses estudos é a escassez de dados, o que impede a obtenção de conclusões confiáveis. Boa parte dos testes usou dados de cortes transversais, o que impede o controle para efeitos temporais dinâmicos ou mesmo efeitos que se diferenciam ao longo do tempo em cada país. Um passo mais consistente foi dado com a publicação da compilação de dados sobre desigualdade feita por Klaus Deininger e Lyn Squire, patrocinada pelo Banco Mundial, que deu origem ao primeiro banco de dados em painel sobre a desigualdade econômica (DEININGER; SQUIRE, 1996). Os estudos empíricos que fizeram uso do Banco de dados

relação ao último quintil da distribuição de renda, impactando, portanto, na redução da pobreza. Ademais, este paper foi o primeiro a incluir uma amostra com vários casos de países pós-comunistas do leste europeu.

[18] Comparando os gastos públicos de Taiwan, Coréia do Sul e Cingapura, Chan (1997) concluiu que os gastos em educação e previdência social aumentaram depois da democratização de Taiwan e Coréia do Sul, enquanto na Coréia do Sul também houve crescimento nos gastos com habitação. Por outro lado, o autor não encontrou efeitos da democracia sobre os gastos em saúde.

de Deininger e Squire (DS) concluíram de maneira mais consistente que mais democracia resulta em menos desigualdade.

Li, Squire e Zou (1998); Chong (2004) e Reuveny e Li (2003) usaram o DS e encontraram uma relação negativa entre democracia e desigualdade. Li, Squire e Zou (1998) mostraram que o nível de liberdades civis, mensurado com os indicadores da Freedom House, e os níveis de escolarização secundária, mais uma medida de abrangência do sistema financeiro e a distribuição inicial de terras são determinantes importantes do nível de desigualdade. Na visão dos autores, as duas primeiras variáveis medem constrangimentos que as elites econômicas e políticas enfrentam para influenciar as políticas públicas e as duas últimas medem fatores estruturais econômicos que moldam o acesso dos pobres ao mercado financeiro. Outro importante achado da pesquisa de Li, Squire e Zou é que a maior parte da variância dos coeficientes de GINI é decorrente de um corte transversal (65%) e não temporal. Mudanças na desigualdade foram muito lentas na maioria dos países, sugerindo que fatores estruturais possuem um papel fundamental na determinação do nível de desigualdade e tornam muito difíceis transformações profundas em curtos períodos de tempo.

Chong (2004) também ofereceu evidências sobre a conexão entre democracia e desigualdade econômica no período de 1960-1995. Em uma regressão transversal, usando médias amostrais para o período e também painéis dinâmicos, o autor encontrou uma relação não monotônica entre democracia e desigualdade, sustentando mais uma vez a possível existência de uma curva de Kuznets política. O conjunto de variáveis controles consistia do PIB per capita inicial, indicadores de saúde (número de médicos por habitante), participação de agricultura e da indústria na economia e a taxa de inflação.

Reuveny e Li (2003), por sua vez, estudaram os efeitos da democracia levando em conta os efeitos da abertura econômica. Para estes autores, ambas as variáveis afetam a desigualdade, enquanto a abertura econômica também afeta a democracia (IM, 1996; WHITEHEAD, 1996; DRAKE, 1998; HELD, 1999). Desta maneira, estudos empíricos que não as levem simultaneamente podem estimar resultados enviesados ao atribuir o efeito de uma à outra. Em sua análise empírica, Reuveny e Li dividem sua amostra por nível de desenvolvimento, testando sua teoria em países desenvolvidos, em países em desenvolvimento e numa terceira com todos os países. Como resultado, concluem que a democracia sempre reduz a desigualdade econômica, enquanto a abertura econômica só reduz a desigualdade nos países em desenvolvimento. Todas as variáveis nos modelos foram computadas como médias por décadas

Do outro lado da moeda, Timmons (2010) replicou a análise de Li, Squire e Zou (1998), Chong (2004), e Reuveny e Li (2003) usando novos e mais robustos dados *The World Income Distribution Database – WIID* (2007)[19], o sucessor do DS, e não encontrou resultados que indicassem algum impacto significante da democracia na desigualdade econômica. Usando em sua análise dados agregados em médias por décadas e por quinquênios, Timmons não encontrou nenhuma relação entre democracia e liberdades civis com as medidas de desigualdade econômica. Sua alegação final é que a questão sobre

[19] UNU-WIDER (Unu/Wider-Undp) (World Institute for Development Economics Research), World Income Database (WIID), Versão 2 (Helsinki: World Institute for Development Economics Research of the United Nations University/UNDP, May 2007). O banco de dados de Deininger e Squire (DS) contém 2634 observações contra 4982 do WIID (Timmons, 2010). Uma discussão aprofundada sobre os diferentes bancos de dado comparados de GINI é apresentada no capítulo 3.

os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica ainda permanece aberta, mas que os novos bancos que compilam dados de natureza longitudinal prometem revolucionar o campo de pesquisa da relação entre desigualdade e democracia.

Alguns estudos realizados no último decênio também desafiaram esse suposto consenso teórico sobre os efeitos dos regimes políticos em relação a outras medidas de desenvolvimento humano. Por exemplo, os estudos de Gauri e Khaleghian (2002) McGuire (2006), Ross (2006) e Shandra, Nobles, London e Williamson (2004) não encontraram correlações positivas e robustas entre indicadores de desenvolvimento humano e a presença de um regime político democrático (GERRING; THACKER; ALFARO, 2012)[20].

1.3 Desenvolvimento, choques tecnológicos e desigualdade

Na análise da relação entre democracia e desigualdade é necessário estarmos atentos para o fato de que existem outros fatores externos que interferem na relação. Por exemplo, uma extensa literatura discute como o desenvolvimento afeta a desigualdade, interagindo com os próprios efeitos da democracia (KUZNETS, 1955). Somando esta discussão à literatura que analisa a associação entre desenvolvimento e democracia, torna-se claro a necessidade de se controlar o seu papel para a estimação dos reais efeitos da democracia sobre a desigualdade. Outros potenciais fatores de confusão descritos nos próximos parágrafos decorrem do papel interveniente dos mercados na

[20] Gauri e Khaleghian (2002) tomaram como variável dependente a cobertura de vacinação da população e Ross (2006), MacGuire (2006) e Shandra, Nobles, London e Williamson (2004) a taxa de mortalidade infantil.

relação entre democracia e desigualdade. Posto isso, apresentamos de maneira bastante sucinta as vertentes da literatura que analisam a relação entre desenvolvimento, mercados, globalização e desigualdade. A metodologia e os dados empíricos serão detalhados nos próximos capítulos.

A análise da relação entre desenvolvimento e desigualdade data da contribuição seminal de Simon Kuznets (1955) na qual o autor defende a hipótese de que durante o processo de desenvolvimento econômico e transformação de uma sociedade rural e agrária em uma sociedade industrial urbana, a desigualdade segue um padrão de U-invertido, com um inicial aumento e posterior queda. A curva de Kuznets se assemelha a uma parábola com concavidade para baixo. Antes do processo de industrialização na Inglaterra e nos Estados Unidos, a atividade econômica principal consistia basicamente em conjunto de pequenos proprietários familiares, cuja renda da atividade agrícola era limitada pelo escopo natural do trabalho familiar. A partir do surgimento de uma vida urbana mais dinâmica nos estágios iniciais da industrialização, a desigualdade tenderia a aumentar. Isso acontecia porque nessa fase ocorria um aumento da demanda por mão de obra nos setores mais modernos da cidade, elevando os salários dos trabalhadores urbanos em detrimento dos que permaneciam na zona rural.

Com o passar do tempo, a migração e, por fim, a industrialização da agricultura deslocou os trabalhadores rurais para a cidade. A população rural declinou, assim como a importância do diferencial de renda entre o campo e a cidade e a desigualdade passou a ser reduzida com o crescimento da renda, sobretudo pelo fato que a população se deslocou do campo, tornando-se urbana. Apesar do fato de que as cidades fossem ambientes econômicos mais diversos que o campo, e naturalmente mais

desiguais, Kuznets tinha a expectativa de que com a maturidade da industrialização, a sindicalização dos trabalhadores e o avanço da social democracia haveria redução ainda mais forte da desigualdade. Assim, a desigualdade como um todo deveria declinar com o aprofundamento do desenvolvimento industrial na medida em que o desenvolvimento econômico urbano progredisse (GALBRAITH, 2012).

A hipótese de Kuznets é motivada para analisar o processo de transição econômica estrutural e demográfica da modernização, mas a relação U-invertida pode surgir a partir de qualquer transição entre atividades com níveis distintos de produtividade. Isto porque com a transição de uma economia centrada em uma atividade de pouca produtividade para uma atividade de alta produtividade há um inevitável aumento da desigualdade durante o processo, em benefício da parcela da população que atua na atividade altamente produtiva. Com o passar do tempo e a transição de boa parte da população para esta atividade, os retornos voltam a ser equiparados.

Outro fator assemelhado à lógica do modelo de Kuznets são os efeitos das novas tecnologias, tal como proposto no modelo de Boix (2010) onde os choques exógenos afetam de maneira incisiva a distribuição de ganhos. O argumento de Kuznets seria apenas um caso especial no qual existe um choque tecnológico – a industrialização – em uma atividade que gera mais renda para determinado grupo da sociedade – a população urbana. Contudo, Boix incrementa o modelo com a possibilidade de criação de barreiras de entrada no novo mercado, premiando aqueles que foram beneficiados inicialmente com a alteração tecnológica[21].

---

[21] Boix (2010) tem como objeto a evolução da desigualdade de longa duração. O primeiro choque exógeno analisado é decorrente da revolução agrária –

O papel da evolução da tecnologia é outro fator crucial na evolução da desigualdade. Na visão de Boix (2010), as evoluções tecnológicas se dividem, basicamente, entre dois extremos: pró-pobres e pró-elites. Um exemplo de choques pró-elites é a descobertas de recursos naturais ou o boom em preços de commodities, que aumentam a desigualdade ao beneficiar aqueles que controlam os recursos naturais de uma dada sociedade. Já um choque pró-pobres é aquele que aumenta mais a renda dos indivíduos pobres em relação à elite e cujos efeitos tendem a ser sufocados caso o eleitor decisivo na sociedade seja membro da elite econômica e não das massas.

Uma das explicações econômicas a respeito do exponencial crescimento da desigualdade econômica nas economias mais avançadas do mundo nos últimos 30 anos tem sido analisada como consequência de um choque econômico pós-revolução tecnocientífica e um decorrente aumento dos retornos da educação. Em revisão da literatura a respeito das causas e consequências da desigualdade, Neckerman e Torche (2007), analisando o caso americano, discutem os efeitos da computadorização do campo de trabalho sobre o aumento do valor de mercado da educação e de habilidades específicas para o uso da tecnologia.

Recentemente Autor, Katz e Kearney (2005; 2006) propuseram uma versão modificada do argumento tecnológico como fonte do aumento das desigualdades nas últimas décadas.

---

domesticação de plantas e animais. Os grupos beneficiados com esse choque econômico exógeno seriam aqueles que exerciam atividades agropastoris em terra mais férteis e produtivas. Com o advento da revolução agrária, esses indivíduos obtiveram mais renda do que aqueles que viviam na periferia das grandes planícies férteis. Tal processo desencadearia uma teia de relações econômicas e políticas que justificaria a formação do Estado e o surgimento de regimes políticos mais ou menos autoritários.

A computadorização aumentaria a competitividade de profissionais altamente qualificados, reduzindo os retornos e a demanda por trabalho rotineiro, normalmente alocados para indivíduos com salários médios. Tais transformações tecnológicas teriam pouco efeito nos salários dos trabalhadores alocados no final da distribuição de renda. Fernandez (2001) inclusive sugere uma associação importante entre o aumento da dispersão salarial e a atualização tecnológica.

Para Galor e Tsiddon (1997) e Aghion e Howitt (1998), a tecnologia aumenta a concentração de trabalhadores qualificados nos setores mais avançados da economia em prejuízo dos trabalhadores menos qualificados, alocados em setores mais atrasados, aumentando a desigualdade de pagamentos. Galbraith (2012) encontra evidências de que o setor industrial é a atividade mais afetada pelas mudanças tecnológicas e a desigualdade induzida pela tecnologia possui características distintas entre diversos setores manufatureiros, tendo reflexo na distribuição dos pagamentos e aumentando a diferença entre os trabalhadores dos setores mais modernos em relação aos outros.

Por fim, Rogowski e MacRae (2008) elaboraram outro modelo a respeito de como as dotações de fatores de produção, o comércio e os choques tecnológicos afetariam as instituições democráticas por meio da alteração dos níveis de desigualdade econômica por, entre outras coisas, aumentar ou reduzir os salários do trabalho em relação ao capital ao afetar a produtividade marginal de ambos de formas diferentes. Entre as mudanças tecnológicas discutidas, Rogowski e MacRae analisam o papel da tecnologia militar sobre o aumento ou diminuição da desigualdade:

> Caso alguma mudança tecnológica como a introdução de melhores táticas de infantaria aumente a produtividade

> marginal do trabalho na produção da força militar, o trabalho tornar-se-á mais valorizado em relação ao capital. A sua remuneração aumentará, seja em termos monetários ou políticos, diminuindo a desigualdade. Da mesma forma, qualquer mudança tecnológica que aumente a produtividade marginal relativa do capital aumentará a desigualdade. (ROGOWSKI; MACRAE, 2008, p. 359)[22].

1.4 Democracia, mercados e desigualdade econômica

Outro tema candente no debate a respeito da evolução da desigualdade na segunda metade do século XX é o papel que a expansão das relações de mercado tem sobre este fenômeno. Conforme apontado por Przeworski (2010), o surgimento da democracia foi uma revolução no mundo da política e não uma revolução social, tal como esperado no século XIX. A equidade política entre os cidadãos não necessariamente significa que a igualdade será difundida para todos outros atributos socioeconômicos que caracterizam a existência humana.

Ademais, a democracia tornou-se, ao longo de sua consolidação no século XX, num sistema político observado em nações com diferentes graus de desigualdade econômica. Isso se torna ainda mais latente ao verificarmos que as democracias políticas funcionam na maioria dos casos em sistemas

---

[22] Exemplos históricos de choques exógenos que aumentaram a produtividade relativa do capital foram as legiões profissionais romanas, a cavalaria armada medieval e os exércitos modernos absolutistas. Já exemplos que aumentaram a produtividade relativa do trabalho foram as forças hoplitas da Grécia Antiga, a peste negra que ao reduzir a oferta de trabalho, reduziu a produtividade relativa do capital em relação ao trabalho ou mesmo a possibilidade de imigração na Europa do século XIX e a sociedade de fronteira dos Estados Unidos, Canadá e Austrália (ROGOWSKI; MACRAE, 2008).

econômicos nos quais os recursos são distribuídos via forças de mercado e que existe uma tendência inequívoca das relações de mercado gerarem e reproduzirem desigualdade econômica ao longo do tempo (PIKETTY, 2014). Przeworski (2010) entende que nenhum sistema político organizado em uma sociedade de mercado pode gerar e manter uma perfeita equidade no campo socioeconômico.

O autor chama atenção para o fato de que além das dificuldades políticas da construção de qualquer mecanismo institucional de redistribuição de recursos, a própria linguagem da redistribuição é anacrônica, refletindo o conflito redistributivo sobre a posse e uso da terra, um bem divisível e manejável por unidades familiares. Nenhum outro insumo produtivo pode ser tão facilmente redistribuído como a terra. Muitas vezes existem barreiras tecnológicas que impedem a redistribuição de um tipo de ativo econômico, como, por exemplo, os insumos de indústrias tecnologicamente avançadas, ou mesmo a própria distribuição de capital humano, um bem não divisível e cujo domínio e expansão geram externalidades positivas muito difíceis de serem controladas via mercado ou mesmo via controle político.

Posto isto, Przeworski (2010) entende que a construção da cidadania igualitária dentro de sistemas políticos democráticos não implica em que as diferenciações sociais entre os cidadãos serão reduzidas, mas sim que o sistema político não observará as diferenças socioeconômicas entre os concidadãos. Assim, o cidadão democrático seria simplesmente o cidadão sem categorização e anônimo. Não sendo iguais e muito menos homogêneos, mas sim necessariamente anônimos perante as leis, as instituições e o próprio sistema político. Desta forma, a potencial tensão entre um sistema de equidade política

e a produção e reprodução de desigualdades via relações de mercados tornar-se-ia tolerável do ponto de vista lógico, ainda que com consequências empíricas e políticas fundamentais[23]. A equidade política seria, assim, a equidade aos olhos do Estado e não nas relações diretas entre os cidadãos.

Por outro lado, é inevitável esperar que de alguma forma o advento da equidade política torne-se um mecanismo de redução das desigualdades econômicas, sobretudo em relação ao direito de propriedade, tal como já exposto na introdução deste capítulo. Contudo, para Przeworski (2010), independente de qual seja o formato institucional do governo, se não houver esforço político ativo e perseverante para a proteção dos mais pobres por meio de algum mecanismo de transferência de recursos para os indivíduos que possuem uma menor capacidade de obtenção de renda, a desigualdade tenderá a crescer em uma sociedade cuja economia é organizada via relações de mercado. A experiência neoliberal das últimas décadas exemplifica tal suposto, pois com a redução do papel do governo na economia dos países capitalistas houve profundo e rápido crescimento da desigualdade (PIKETTY, 2014).

Outra justificativa crucial para o controle dos fatores relativos ao fenômeno da expansão das relações de mercado decorre do fato de que com o fim da Guerra Fria e a terceira

---

[23] Przeworski (2011a) analisa o papel que as diferenças econômicas têm no curso normal da competição política e como uma distribuição de renda desequilibrada afeta a capacidade de influência dos indivíduos detentores de menos recursos. Na visão de Przeworski alguns cidadãos não podem equalizar o custo marginal da influência na política com os benefícios marginais decorrentes, pois sofrem constrangimentos orçamentários, o que, portanto, tem como consequência direta um viés político favorável aos cidadãos detentores dos recursos econômicos. Para uma discussão sobre os mecanismos pelos quais o dinheiro afeta a política vide (PRZEWORSKI, 2011a; 2012).

onda da democratização (HUNTINGTON, 1993) ocorrem dois processos distintos, mas concomitantes: a expansão de regimes políticos democráticos e a expansão de processos econômicos liberalizantes em temas de comércio exterior e das próprias relações econômicas internas, denominado na literatura como onda neoliberal. Como esses dois processos ocorreram ao mesmo tempo é bastante provável que os reais efeitos da democracia sobre a desigualdade foram mitigados pelos efeitos das relações econômicas menos reguladas.

Do mero fato que um país se democratiza e apresenta dados crescentes de desigualdade não decorre que a democracia não seja uma força equalizadora da sociedade, mas sim que o resultado líquido da soma dos efeitos dos mercados e da democracia é positivo. Isto porque a partir da década de 1990, muitos países tornaram-se democracias, ao mesmo tempo em que optaram por agendas de políticas econômicas mais liberalizantes. Desta maneira, é de fundamental importância desagregar os efeitos sobre a desigualdade causados por relações de mercado dos efeitos causados pela competição eleitoral em eleições democráticas.

Os processos de democratização política e liberalização econômica, embora concomitantes, são independentes. A história chilena na segunda metade do século XX ilustra bem esse fato. Antes do golpe comandado pelo general Augusto Pinochet, o então presidente Salvador Allende, que havia sido eleito democraticamente, estava direcionando a política econômica chilena para um ponto distante de políticas voltadas à liberalização de mercado. E depois de 1973, o regime militar de Pinochet colocou o Chile no caminho da liberalização econômica em um momento em que não havia liberdade política. O golpe militar chileno é paradigmático para ilustrar como

liberdade política e liberdade econômica podem estar separadas, uma vez que o oposto à liberdade política é autoritarismo, enquanto a antítese da liberdade econômica é o planejamento centralizado. Posto de outra forma, a liberdade política não é equivalente à liberdade de comprar, ainda que muitas vezes teóricos econômicos como Milton Friedman tenham feito essa associação equivocada (GALBRAITH, 2008). Nas palavras do economista James Galbraith:

> Enquanto isso, o regime de mercado livre de Augusto Pinochet trouxe a liberdade econômica para o Chile. As pessoas podiam ser livres economicamente sem ter qualquer voz na política, enquanto viviam sob os coturnos de uma junta militar. (GALBRAITH, 2008, p. 16).

Argumentação semelhante é feita por Cardoso (2011) ao analisar o tema do debate político sobre o liberalismo no Brasil contemporâneo:

> E como o liberalismo econômico leva à desigualdade, acabamos por não acreditar no liberalismo político, que é um valor. O liberalismo político é um valor que foi reivindicado pelos socialistas no século XIX, inclusive por Marx. A liberdade política como valor político é extremamente importante. A liberdade como laissez-faire econômico é inaceitável sem contrapesos. Um regime de liberalismo econômico não leva à igualdade e nem, no limite, à liberdade política. Mas há confusão entre esses termos. (CARDOSO, 2011, p.58).

Por fim, é de fundamental importância analisar *se* e *o quanto* a expansão das relações de mercado podem afetar a desigualdade econômica, tal como esperado por Przeworski, Pikkety e Galbraith. Há vasta discussão sociológica e econômica

que data desde as contribuições de pensadores do século XIX como Karl Marx, passando pela obra de Karl Polanyi (1957; 2013), de que a economia de mercado, ao ser guiada pela busca e expansão dos lucros, tende a reduzir a participação do trabalho nos ganhos, tratando-a necessariamente como uma entre outras simples commodities e aumentando, assim, a distância entre ricos e pobres.

Outras abordagens como a teoria da dependência (CARDOSO E FALLETO, 1970; EVANS, 1979) e Evans (1979) e a teoria das vantagens cumulativas de (MERTON, 1973) indicam também que em uma economia de mercado os ricos expandem a sua renda a uma taxa maior do que os pobres, aumentando a sua vantagem relativa. Um possível mecanismo por detrás do fenômeno da expansão dos mercados é que o poder de barganha do trabalho é limitado quando a propriedade dos meios de produção encontra-se na mão de um grupo reduzido de indivíduos, os capitalistas.

Estudo de Szelenyi e Manchin (1987) sobre a expansão das relações de mercado na Hungria indica, outrossim, que a liberalização teve como consequência principal a pauperização real dos que ocupam as menores faixas da distribuição de renda. Outros trabalhos que focaram a emergência da economia de mercado no Leste Europeu também endossam a visão de que os mercados ampliam a desigualdade econômica, prejudicando os mais pobres e beneficiando um pequeno grupo de privilegiados (HANKISS, 1990a; b; STANISZKIS, 1991; RONA-TAS, 1994).

O mesmo padrão se repete na China, onde, seguindo os padrões teorizados por Simon Kuznets, há uma enorme diferenciação dos ganhos no campo em relação aos ganhos do setor urbano, centro do dinamismo econômico chinês após a introdução e avanço das reformas econômicas modernizantes

e orientadas para o mercado de Deng Xiaoping (ZHAO, 1993). Os efeitos de ampliação da desigualdade decorrentes da expansão das relações de livre mercado são ainda mais fortes quando os indivíduos que se veem livres para competir por remuneração e renda possuem diferentes estoques de capital humano e/ou diferentes conjuntos de talentos e habilidades (NEE; LIEDKA, 1997).

Diante de tais constatações, Przeworski (2012) tenta enunciar uma "Lei Newtoniana" da desigualdade, na qual a desigualdade de renda tende a crescer como resultado da operação dos mercados quando o governo não atua ativamente para contrabalancear e frear tal tendência. Fora isso, a tendência ao crescimento e manutenção da desigualdade de mercados simplesmente persiste e tende a ser reduzida de forma aguda somente na presença de eventos catastróficos como revoluções sociais (União Soviética), intervenções militares externas (papel japonês na Coréia ou soviético no Leste Europeu), guerras ou emigração maciça dos pobres (Noruega e Suécia) ou mesmo o próprio efeito da 1ª e 2ª Guerra Mundial como indutor da redução da desigualdade salarial nos EUA e na Europa Ocidental (GOLDIN; MARGO, 1992), (SCHEVE; STASAVAGE, 2009) e (PRZEWORSKI, 2012)[24].

---

[24] Piketty (2014), Piketty e Saez (2003; 2006) e Moriguchi e Saez (2008) demonstram que países como França, Reino Unido, EUA e Japão assistiram a uma forte redução da desigualdade durante a 1ª e a 2ª Guerra Mundial que deve ser atribuída a uma queda drástica da renda do capital do topo da distribuição de renda, uma vez que fortunas foram reduzidas como resultado da inflação em tempos de guerra e da própria taxação para o esforço militar, associados à introdução do imposto de renda progressivo.

1.5 Globalização e comércio internacional

Como a expansão das economias de mercado é um processo complementado pelo aprofundamento da globalização, estando ambos associados temporalmente à própria expansão da democracia pelo mundo, é necessário separar as contribuições de cada um destes três fatores sobre a desigualdade econômica. Podemos considerar a democratização, a liberalização econômica e a globalização como o tripé fundamental da nova ordem internacional e, portanto, que constituem fenômenos nitidamente inter-relacionados. Isto porque o exponencial crescimento das relações de mercado no último quartel do século XX estimulou de maneira inequívoca a aceleração do processo de globalização. A própria expansão dos mercados ocorre concomitantemente à democratização das relações políticas dentro das nações, embora a aproximação entre mercado e democracia seja mais tensa que a afinidade entre mercados e globalização.

Frankel (2000) entende a globalização econômica como uma das forças mais poderosas que moldaram o mundo no pós-guerra. Em particular, o comércio internacional de bens e serviços, que se tornou cada vez mais importante ao longo dos últimos 60 anos e os fluxos financeiros nos últimos 40 anos. Em sua opinião, os vetores do processo de globalização econômica são os avanços tecnológicos que permitiram a redução dos custos de transportes e comunicações na atuação do setor privado e a redução das barreiras sobre os fluxos comerciais e financeiros por parte do setor público.

A literatura comparada ainda não produziu conclusões consensuais a respeito do que seja a globalização e mesmo de quais são os efeitos da própria expansão das economias de

mercado sobre o agravamento ou não da desigualdade econômica. Nas palavras de Brune e Garret (2005), o debate sobre os efeitos da globalização econômica sobre a desigualdade assemelha-se a um gigante teste de Rorschach: os analistas observam o mesmo tipo de informação, mas tendem a tomar conclusões diferentes e normalmente enviesadas ideologicamente.

O consenso não emergiu entre outras coisas, pois a própria definição do que signifique o constructo globalização ainda não é consensual. Em consequência, as propostas de mensuração empírica do construto são bastante contestáveis, pois tendem a simplificar o complexo fenômeno em termos de integração de mercado de bens, serviços ou de capitais. Por exemplo, alguns pesquisadores mensuram o quanto um país é integrado ao mercado global por meio da análise de fluxos de comércio ou de capital (RODRIK, 1998a; b), (DOLLAR; KRAAY, 2001) e (MILANOVIC, 2003; 2005) ou por meio da análise de medidas de política econômica, como, por exemplo, níveis tarifários e abertura do mercado de capitais (QUINN, 1997), (GARRETT, 1998a), (BIRDSALL; HAMOUDI, 2002), (SWANK, 2003), (BRUNE; GARRETT; KOGUT, 2004) e (GARRETT, 2004).

Ademais, outros fatores de confusão do próprio processo de expansão da globalização precisam ser integrados à análise. Os acordos de livre comércio e o próprio processo de integração econômica e política regional, como, por exemplo, o MERCOSUL e a UNIÃO EUROPÉIA (UE), possuem efeitos sobre a velocidade da integração econômica e sobre a própria distribuição de bens entre os indivíduos (BECKFIELD, 2006; 2009) e (PASTOR; SERRANO, 2012). Beckfield (2009), por exemplo, apresenta dados em que, de um lado a integração europeia reduziu a diferença entre países e do outro aumentou

a desigualdade dentro de cada país. Os acordos regionais não apenas criam comércio e fomentam investimentos dentro da região, mas também afetam a distribuição de recursos nos países membros da união como desviam comércio e investimentos que seriam realizados em países que estão fora do acordo.

É bastante razoável assumir a hipótese de que os efeitos da globalização em sociedades muito desiguais sejam distintos dos efeitos em sociedades que já possuem uma cesta de bens distribuídos de maneira mais uniforme. O modelo de Heckscher-Ohlin (HO), por exemplo, prevê, adaptando-o à economia contemporânea globalizada, que o surgimento de um mercado comum global afeta de maneira distinta os países nos quais o trabalho qualificado é abundante daqueles onde há mais trabalhadores dotados de poucas habilidades (BRUNE; GARRETT, 2005; MESCHI; VIVARELLI, 2009). A intuição é simples: com a redução das barreiras contra a livre circulação de bens e investimentos, os salários relativos dos trabalhadores nos setores com vantagens comparativas devem subir. E nos países mais desiguais as vantagens comparativas estariam concentradas nas atividades das quais participam os trabalhadores menos qualificados, enquanto nos países mais iguais, as vantagens residem nas atividades das quais participam os trabalhadores mais qualificados (BEYER; ROJAS; VERGARA, 1999).

Em outro enfoque abordado por Boix (2011) existe uma discussão importante a respeito dos efeitos da globalização econômica do ponto de vista da oferta e da demanda por redistribuição. Em relação ao primeiro, a oferta de redistribuição deve diminuir, pois a capacidade dos estados perseguirem políticas econômicas autônomas dentro de seu próprio país é prejudicada pela integração global, uma vez que se veem constantemente ameaçadas pela possibilidade dos fatores de

produção, sobretudo o capital, migrarem para outros países na presença de políticas que afetem suas respectivas margens de lucro, como, por exemplo, uma política que aumenta a transferência de renda da elite para segmentos menos favorecidos da sociedade[25].

Wood (1994) atribuiu o crescimento da desigualdade nos últimos quarenta anos nas economias mais desenvolvidas ao resultado da globalização e à crescente competição com as economias em desenvolvimento, que possuem vantagens comparativas na produção de bens trabalho-intensivo, o que resulta numa redução dos salários dos trabalhadores pouco e semiqualificados nas economias mais avançadas. Autor (2010) e Spence e Hlatshwayo (2012) mostraram que o processo de globalização está associado a uma crescente polarização do emprego e salário entre os setores econômicos da América do Norte e Europa.

Por outro lado, do ponto de vista da demanda por redistribuição, quanto maior for o efeito da globalização sobre o aumento da desigualdade econômica, maior será a demanda por políticas redistributivas e por taxações que compensem os perdedores nacionais do jogo econômico global. Cameron (1978) observou que o melhor preditor do tamanho do setor público (fração do PIB) entre o período de 1960-1975 é o grau de abertura econômica, mensurado pela soma das exportações e importações sobre o próprio PIB. O mesmo foi encontrado

---

[25] Em um dos modelos formais em Boix (2011), a globalização da economia nacional restringe os graus de liberdade do governo na elaboração de políticas redistributivas, ao reduzir a margem de imposto possível de ser aplicado. Ao se considerar que a mobilidade internacional dos ativos importa é esperado que o orçamento público se baseie mais nos setores específicos, como o próprio trabalho, do que nos menos específicos, como o capital. Isto porque esse último é mais apto a deslocar-se dentro da economia globalizada que o primeiro.

por Rodrik (1996), que mostrou que quanto maior o risco externo decorrente das flutuações econômicas internacionais, maior é o setor público, uma vez que o emprego e a renda derivada deste setor não se correlacionam com choques externos de curto prazo.

Garret (1998b) também associa o tamanho do setor público com a abertura comercial, enquanto Mares (2005) encontra uma associação entre a introdução de esquemas de proteção social em decorrência da maior abertura. Adserà e Boix (2002) desenvolvem o argumento de que a abertura comercial só ocorre se os beneficiários oferecem compensações aos perdedores. Boix (2011) relata como a abertura comercial esteve associada à introdução de mecanismos de compensação no Reino Unido, Escandinávia, Austrália e Nova Zelândia entre 1830 e 1950 e na Europa do Sul entre 1930 e 1980. Por fim, Avelino, Brown e Hunter (2005) mostram que uma maior abertura econômica se correlaciona com maiores gastos sociais e educação na América Latina entre 1980 e 1999.

Boix (2011) inclusive aponta que este descompasso entre os efeitos da globalização sobre a demanda e oferta de redistribuição está nas raízes do descontentamento que certos setores da sociedade têm em relação ao mundo globalizado. O descontentamento de certos grupos decorre da percepção dupla de que a globalização impõe custos sociais e ao mesmo tempo reduz a capacidade de ação dos governos nacionais gastar tal como os cidadãos, no caso o eleitor mediano, preferem, pois limitam os graus de liberdade de taxar, tornando pior o bem-estar daqueles que perdem com a integração econômica.

Hobsbawn (2007) aponta os efeitos negativos da globalização em termos da expansão da desigualdade econômica da seguinte forma, inclusive trazendo potenciais repercussões políticas danosas para estabilidade dos regimes políticos:

> A globalização acompanhada de mercados livres, atualmente tão em voga, trouxe consigo uma dramática acentuação das desigualdades econômicas e sociais no interior das nações e entre elas. Não há indícios de que essa polarização não esteja prosseguindo dentro dos países, apesar de uma diminuição geral da pobreza extrema. Este surto de desigualdade, especialmente em condições de extrema instabilidade econômica, como as que se criaram com os mercados livres globais na década de 1990, está na base das importantes tensões sociais e políticas do novo século. (HOBSBAWN, 2007, p. 11).

Posto tal debate bastante polarizado e pouco consensual sobre as relações das três variáveis de interesse: mercados, democracia e globalização; apontamos a necessidade de se controlar os efeitos que a economia de mercado e a expansão da globalização econômica têm na relação entre democracia e desigualdade. Assim, no próximo capítulo apresentamos a abordagem com a qual tentamos eliminar as relações de confusão que as variáveis de mercado e globalização impõem à capacidade da democracia em reduzir a desigualdade econômica dentro de uma determinada sociedade.

1.6 Causalidade reversa: os efeitos da desigualdade sobre os processos de democratização

O último problema teórico a ser tratado neste capítulo decorre da existência de uma vasta literatura que busca analisar os efeitos da desigualdade como determinante dos processos de democratização. Nessa literatura a desigualdade é tratada como um entrave à possibilidade de um país tornar-se democrático, uma vez que quanto mais desigual for o país,

mais a elite econômica tem a perder com a adoção do sufrágio universal em eleições competitivas nas quais as massas podem atuar livremente.

Nessas circunstâncias as sociedades com um alto grau de desigualdade não seriam um terreno fértil para a democracia. Modelos teóricos elaborados por Carles Boix (2003) e Acemoglu e Robinson (2006) tomaram como base o modelo de Meltzer e Richard e propuseram que o aumento da desigualdade tende a reduzir a probabilidade de uma ditadura transitar para um sistema democrático. Isto porque a ameaça de redistribuição de riqueza com a adoção do voto majoritário livre e a transferência do poder para as massas estimula a adoção de soluções antidemocráticas pelas elites política e econômica, que temem a expropriação de suas riquezas.

A lógica formal teórica da relação entre renda média e a renda mediana do modelo redistributivo de Meltzer e Richard é a mesma aplicada nos estudos sobre a transição democrática, que frequentemente enquadram as transições entre democracia e ditadura como uma disputa redistributiva (BOIX, 2003), (ACEMOGLU; ROBINSON, 2006) e (HOULE, 2009). Estas abordagens atualizaram os estudos de Barrington Moore (1966) e Rueschemeyer, Stephens e Stephens (1992) ao modelarem as formas nas quais as receitas do governo interagem com as demandas da sociedade e como o estado democrático pode servir como um compromisso crível com a redistribuição no futuro.

Boix (2003) propõe uma relação linear negativa entre desigualdade e democratização: quanto mais desigual for um país, menor será a probabilidade de ocorrer uma transição democrática. Os efeitos da desigualdade só são atenuados quando parte da riqueza da elite se encontra em tipos de capital que não são fixos (como, por exemplo, capital financeiro), uma

vez que a flexibilidade de movimentação possibilita à elite econômica uma rota de fuga caso o poder político deseje extrair parte de sua propriedade. Assim, o cenário no qual a democratização é menos provável é justamente aquele no qual existe uma grande desigualdade econômica e a riqueza da elite é baseada em um capital fixo, como terra, que pode ser facilmente taxado e extraído pelo poder político.

Por sua vez Acemoglu e Robinson (2006) propõem que existe uma curva em formato de U-invertido entre desigualdade e probabilidade de democratização. Nas sociedades mais iguais as camadas populares não demandam maiores direitos políticos, pois a distribuição de recursos é equitativa e a obtenção do poder político não melhorará o bem-estar dos desfavorecidos e assim a probabilidade de democratização é baixa. Por outro lado, nas sociedades mais desiguais, ainda que exista uma forte demanda por redistribuição pelas camadas mais pobres, os custos da tolerância política da elite em relação à maioria pobre são muito altos e uma solução autoritária e repressora emerge. Por fim, apenas nas sociedades medianamente desiguais há uma maior probabilidade de democratização, uma vez que os custos de repressão são maiores que os custos da redistribuição e, além do mais, as massas possuem incentivos suficientes para se mobilizarem e organizarem. Assim, quando o problema de ação coletiva das massas for superado, a elite política e econômica responde às demandas por redistribuição econômica com a transferência do poder político para as massas.

O ponto fundamental do argumento de Boix e Acemoglu e Robinson é de que apenas com a efetiva transferência de poder da elite para as massas é que a redistribuição demandada tornar-se-ia crível. Mais uma vez, tal como na literatura

que analisa os efeitos da democracia sobre a redistribuição, é feito um silogismo perfeito entre a igual distribuição de direitos políticos e a igual distribuição de recursos econômicos. Por outro lado, ainda que do ponto de vista teórico exista uma provável endogenia na relação entre democracia e desigualdade, do ponto de vista empírico a hipótese sobre quais são os efeitos da democracia sobre a desigualdade ainda é disputada. Adotando diferentes abordagens Houle (2009) não encontra uma associação clara entre desigualdade e democratização política, ainda que encontre uma relação entre igualdade e consolidação democrática. Já Ansell e Samuels (2010 e 2014) apresentam uma contraposição teórica na qual o aumento da desigualdade econômica está associado ao surgimento de uma classe média e, portanto, tende a aumentar a probabilidade de democratização de uma dada sociedade, invertendo completamente o modelo redistributivista de Meltzer e Richard.

O trabalho de Ansell e Samuels (2010 e 2014) parte de uma constatação empírica poderosa. Enquanto a desigualdade na Inglaterra no século XIX tinha um GINI de 0.51, a desigualdade na China era de 0.24 e, como sabido, a probabilidade de surgimento de um regime democrático era maior no primeiro caso. Essa ponderação decorre do fato que as novas classes que surgem no processo de modernização econômica (a burguesia e a classe trabalhadora) possuem uma renda superior à renda do eleitor mediano. Desta forma, o surgimento dessas novas classes que demandam por proteção contra a autoridade despótica do governo está associado a um aumento da desigualdade econômica e não a um aumento da igualdade.

Assim, Ansell e Samuels reveem as suposições teóricas do modelo redistributivo e colocam como questão chave no processo de democratização o medo de expropriação por

parte da burguesia que surge a partir da modernização econômica contra os poderes absolutistas do Estado. Isto porque o aumento do coeficiente de GINI em países em desenvolvimento reflete o surgimento de uma classe média, mesmo que a maioria da população ainda permaneça na pobreza. Desta forma, o potencial eleitor mediano em sociedades em desenvolvimento é sempre um membro da classe mais empobrecida e que não participa e nem tem voz no mundo da política, colocando em questão todos os modelos redistributivos que fazem suas previsões a partir da preferência por redistribuição do eleitor mediano em situação autoritária.

Desta forma, o processo de democratização não se daria por intermédio da lógica da redistribuição, mas sim a partir da criação de uma classe média (composta pela burguesia e/ou a classe trabalhadora), que exigiria proteção contra as arbitrariedades do poder autocrático. Portanto, a ameaça fundante da democracia não foi a ameaça de redistribuição, mas sim a ameaça de extração. A democratização não foi sobre redistribuição, mas sim sobre taxação sem representação: um conflito entre elites econômicas rivais sobre o controle da autoridade coercitiva e expropriativa do Estado. O fundamento da democracia seria, portanto, o temor à ameaça à liberdade e à propriedade e não o ideal de transformação do poder político em igualdade econômica (ANSELL; SAMUELS, 2010; 2014).

❖

Neste capítulo apresentamos uma pequena amostra da vasta literatura que trata do tema da desigualdade econômica e de algumas das polêmicas que envolvem o debate. A longa lista de estudos demonstra a importância do tema na economia

política comparada e como a discussão sobre a relação entre democracia e igualdade econômica é vasta e controversa. Nas primeiras seções apresentamos como a democracia é tratada na literatura da ciência social como um mecanismo de redução de disparidades econômicas, assumindo quase que um silogismo de que a igualdade política tem como consequência inevitável a igualdade econômica. Nas seções seguintes apresentamos novos problemas teóricos que mostram que a associação entre igualdade política e igualdade econômica não pode ser feita de maneira tão direta e inequívoca.

A presença de uma associação empírica entre liberdade política e liberdade econômica introduz ao problema uma série de dificuldades para que quaisquer tipos de sistemas políticos democráticos produzam a tão esperada igualdade econômica, uma vez que a existência de um sistema de trocas institucionalizado a partir de relações de mercado tem como consequência principal a criação de desigualdades. Problemas que se tornam ainda mais complexos com a globalização das relações políticas e econômicas e com os efeitos dos diferentes choques tecnológicos, que em algumas vezes melhoram a situação do trabalho, vis-à-vis do capital, e em outras vezes têm como consequência uma aceleração dos processos fomentadores de desigualdade.

Por fim, apresentamos a literatura que analisa a relação inversa ao interesse desta pesquisa. Existe importante, ainda que recente discussão sobre os efeitos da desigualdade econômica no processo de democratização em sociedades autoritárias, embora não seja possível assumir com clareza quais são os verdadeiros efeitos do crescimento da desigualdade para a inauguração e consolidação de democracias, uma vez que os achados de Ansell e Samuels (2010; 2014) vão na

contramão do modelo redistributivo de Boix (2003) e Acemoglu e Robinson (2006).

Com efeito, no próximo capítulo apresentamos uma nova proposta teórica a respeito da relação entre democracia e desigualdade, de forma a mediar os efeitos do debate sobre a desigualdade entre outras dimensões que também importam no mundo da política, tal como desenvolvimento, crescimento, etnicidade e outras clivagens políticas. Em seguida, introduzimos a metodologia de pesquisa que busca investigar os diferentes problemas levantados nesse capítulo e na seção teórica do próximo. Por fim, no terceiro capítulo, finalizamos a introdução do problema ao apresentarmos quais são os requisitos, conceitos e critérios utilizados para mensurar o sistema político e o tamanho da desigualdade econômica de determinado país em determinado ano.

Teoria e metodologia

Após a breve discussão de alguns dos principais debates da economia política comparada sobre a desigualdade, neste capítulo apresentamos a contribuição teórica e a metodologia adequada para analisar as nossas hipóteses de pesquisa, expostas ao fim da seção 2.1.

Na primeira seção discutimos um tema pouco explorado no debate sobre a relação entre democracia e desigualdade: as condições necessárias para a competição política partidária ser realizada sobre o tema da desigualdade econômica. O ponto de partida teórico é o diagnóstico de que até agora a literatura sobre o tema parte de um pressuposto entre democracia e desigualdade que embora possa ser testado ainda não foi avaliado adequadamente: a homogeneidade dos efeitos da democracia ao longo da distribuição da desigualdade econômica. Isto é, se de fato o efeito da democracia sobre a desigualdade é o mesmo em sociedades iguais, em sociedades medianamente desiguais e em sociedades muito desiguais. A nossa abordagem teórica tentará responder esta questão fundamental para se compreender corretamente quais são os reais efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica.

Na segunda seção apresentamos a metodologia da regressão quantílica que é a mais adequada para testar as hipóteses rivais da homogeneidade ou heterogeneidade dos efei-

tos da democracia ao longo da distribuição da desigualdade econômica. Além disso, apresentamos também o ferramental metodológico de variável instrumental a partir do qual lidamos com o problema da causalidade inversa na relação entre democracia e desigualdade, de forma a verificarmos o que de fato é efeito da democracia sobre a desigualdade e não apenas reflexo dos próprios limites que o excesso de desigualdade econômica coloca na criação de sistemas políticos democráticos.

2.1 Ativando a desigualdade como tema eleitoral

A principal contribuição teórica da pesquisa é preencher a lacuna existente na literatura de economia política comparada a respeito da suposição, não testada, de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são homogêneos ao longo de diferentes contextos de desigualdades. Contudo, tal suposição não parece ser crível quando trazemos à baila o problema da multidimensionalidade da política democrática e ponderamos acerca de quais são as condições que estimulam o surgimento de uma demanda por redistribuição entre o eleitorado e, de outro lado, um interesse partidário em ofertar plataformas e políticas públicas que tratem diretamente deste problema socioeconômico. Posto isso, desenvolvemos a hipótese de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade variam ao longo do próprio eixo da desigualdade econômica, sendo mais efetivos justamente nas sociedades mais desiguais, justamente aquelas nas quais existe maior possibilidade de surgir uma demanda e uma oferta por políticas redistributivas.

A construção desta proposta teórica parte de uma concepção minimalista e procedimental de democracia. Ao longo

de toda pesquisa associamos o regime político democrático ao próprio processo de definição das lideranças e autoridades políticas via eleições. Desta maneira, a democracia é definida basicamente como um regime no qual as posições centrais de governo são preenchidas segundo os resultados de eleições competitivas, livres, certas e justas (PRZEWORSKI, 1991; VREELAND, 2003; SCHUMPETER, 2013)

Esta definição possui dois elementos fundantes: posições centrais de governo e competição política por meio de eleições. As posições centrais são os órgãos fundamentais da vida política de qualquer comunidade – os postos responsáveis pela criação e execução das leis. E para um regime ser democrático é necessário que o preenchimento das cadeiras nos corpos legislativo e executivo seja realizado por meio de um método eleitoral aberto e competitivo. Isto porque a existência de competição política indica a concorrência dos agentes políticos por esses postos, de forma que exista oposição ao atual governo cujas chances de vitória são reais[26].

Diante desta definição de democracia como competição política, uma importante questão para a discussão da relação entre democracia e desigualdade foi, a nosso ver, deixada de lado pela literatura. Quais são as condições nas quais às lideranças partidárias de fato optam por destacar a questão da desigualdade econômica como argumento eleitoral em busca da

---

[26] As eleições necessitam de três condições fundamentais para cumprir com seu papel de mecanismo competitivo de definição das posições centrais do governo: i) incerteza *ex ante* de quem seja o vitorioso da competição eleitoral; ii) irreversibilidade *ex post* do resultado da competição eleitoral; e iii) repetitividade da competição eleitoral. Estas três características fundamentais determinam se as eleições são competitivas, livres, certas e justas. Uma justificação mais pormenorizada das razões teóricas e metodológicas da escolha da definição minimalista e procedimental de democracia é apresentada no Capítulo 3.

obtenção de votos e apoio dos cidadãos e elaboram políticas públicas para reduzi-la? Propomos que essas condições se relacionam ao contexto socioeconômico que estimula (ou não) a oferta de plataformas políticas por parte das elites políticas e também cria ou arrefece a demanda por algum tipo de ação redistributiva no seio da cidadania, isto é por todos aqueles que participam da decisão sobre quem ocupa as posições centrais do governo[27].

Do lado da oferta de plataformas políticas, é necessário incorporar a análise do cálculo do custo e benefício para os partidos das diferentes estratégias eleitorais disponíveis e quando se torna interessante para os competidores elaborar um discurso que tenha como centro o debate sobre a desigualdade econômica. Já do lado da cidadania, a massa de eleitores, é necessário observar quais são as condições que estimulam o surgimento de uma demanda política por redistribuição econômica na maior parte do eleitorado. Caso não se verifique simultaneamente uma demanda por redistribuição e um ganho político por parte dos partidos com a oferta de plataformas que atendam a esta demanda, não é esperado que a competição democrática tenha qualquer impacto sobre a distribuição de recursos econômicos.

Para tal, assumimos o pressuposto, a nosso ver não restritivo, de que em toda e qualquer comunidade política existe uma miríade de temas que podem ser politizados no debate entre os partidos e a cidadania. Assim, não é em qualquer momento ou contexto socioeconômico que a questão da desigualdade econômica será trazida à tona e recursos públicos e

[27] Usaremos o termo cidadania, massa de eleitores e eleitorado como sinônimos que se referem ao conjunto de indivíduos aptos a exercer o direito político do voto.

partidários serão despendidos com o intuito de minimizá-la. Outros problemas políticos latentes podem ser estimulados pelas lideranças políticas ou mesmo demandados pela própria cidadania. Exemplos são questões relacionadas à segurança nacional, os imperativos do desenvolvimento econômico, a defesa de princípios étnicos ou religiosos, separatismos ou mesmo a manutenção da unidade nacional, entre outros.

Piketty (2014) exemplifica esse fato ao lembrar que no período pós-Segunda Guerra Mundial, o debate político na Europa Ocidental era essencialmente voltado para o esforço de reconstrução nacional e não para os problemas da desigualdade econômica. Ademais, a própria questão da desigualdade econômica pode ser vista segundo outros prismas que não o problema da distribuição dos recursos entre os cidadãos. Gilens (2009) apresenta dados que relacionam o debate norte-americano sobre o estado de bem-estar social com a questão racial e econômica. A principal consequência desta associação entre pobreza e raça nos EUA foi reduzir a suscetibilidade política do argumento igualitário em uma sociedade na qual a raça é um componente importante do debate político[28].

Desta forma, o pressuposto assumido pelo modelo redistributivo de Meltzer e Richard (1981), de que a política ocorre em uma única dimensão ideológica, pode ser uma hipótese demasiadamente forte[29]. Com efeito, o pressuposto da

[28] Poole e Rosenthal (2001) mostraram que os votos dos congressistas americanos desde 1789 são melhor explicados por duas dimensões: a questão tributária e a questão racial (escravidão antes da Guerra Civil e integração/direitos civis depois). Mais de 85% da variância dos votos no congresso estadunidense são explicados por essas duas dimensões.

[29] No capítulo 1 apresentamos uma descrição mais pormenorizada sobre o modelo redistributivo de Meltzer e Richards e uma discussão crítica a respeito da validade de suas conclusões teóricas.

unidimensionalidade é assumido como ferramenta heurística de simplificação da realidade política, visando facilitar a modelagem ou teorização informal sobre os principais efeitos e padrões da competição político-eleitoral. Contudo, ao assumir este pressuposto simplificador e deduzir implicações teóricas sobre os efeitos da competição política unidimensional nas eleições e no próprio desenrolar do sistema político analisado, é necessário o retorno à realidade sensorial para verificar se essas implicações teorizadas encontram respaldo empírico[30].

O modelo do eleitor mediano apresentado por Hotelling (1929) e refinado por Downs (1957) é a ferramenta tradicional para o estudo do impacto da competição eleitoral nas sociedades democráticas e é o *framework* a partir do qual Meltzer e Richard elaboram o modelo redistributivo. O modelo do eleitor mediano assume uma competição política unidimensional e propõe a existência de um contínuo político, polarizado entre esquerda e direita, com um único equilíbrio: a apresentação pelos partidos de plataformas eleitorais de acordo com as orientações ideológicas do eleitor mediano (assumindo uma competição bipartidária).

Analisando a relação entre taxas de tributação e transferências de renda, Meltzer e Richard (1981) mostram que o ponto de equilíbrio do tamanho do governo em uma dada sociedade democrática seria definido pela distância da renda do eleitor mediano à renda média da população. Existindo,

---

[30] Piketty (2014) aponta problemas semelhantes ao estudar a evolução da desigualdade econômica nas economias mais desenvolvidas. Para o autor a ciência econômica norte-americana (sobretudo) nas últimas décadas dedicou-se excessivamente ao desenvolvimento de modelos teóricos, deixando de lado a verificação empírica das implicações postuladas.

portanto, uma tendência à redistribuição do topo para a base, uma vez que a curva de renda é usualmente desviada para a esquerda. Assim, em qualquer regra de votação na qual o eleitor mediano possui renda menor do que a renda média, existiriam incentivos para a redistribuição por meio da taxação dos mais ricos.

Ainda que não desejemos criticar o valor pedagógico da simplificação unidimensional, é preciso reconhecer que o tema que divide este espectro ideológico nem sempre é o mesmo, dependendo das circunstâncias e contextos nos quais a competição política ocorre. Em uma democracia, é razoável supor que a apresentação de quaisquer pautas políticas e mesmo a criação de políticas públicas com foco no horizonte eleitoral é feita em direção a temas que tenham um maior potencial de atração de votos. E o mesmo acontece com a desigualdade econômica.

O suposto de Meltzer e Richard (1981) de que a competição eleitoral sempre se dá sempre em torno das diferenças entre a renda média e a renda mediana de determinada comunidade política não reflete o fato que essa diferença só será politizável dadas certas circunstâncias socioeconômicas. Por exemplo, o próprio nível absoluto da distância entre a renda do eleitor mediano e a renda média e a não existência de debates e tensões que dividem a metade inferior da distribuição de renda em outras clivagens políticas além da questão redistributiva[31].

---

[31] A evolução da opinião pública polonesa sobre a desigualdade ao longo da década de 1990 é clara sobre isso. No início do processo de democratização e transformação econômica a desigualdade foi enxergada segundo um viés positivo: reflexo da ampliação das oportunidades com as reformas econômicas pós-comunistas. Com o passar do tempo a tolerância à crescente desigualdade

Ademais, os resultados dos testes empíricos sobre o modelo redistributivo foram insatisfatórios. As análises realizadas encontram um resultado absolutamente distinto daquele preconizado pelo modelo teórico. São justamente as sociedades mais igualitárias que tendem a produzir maior redistribuição do que as sociedades mais desiguais (BERAMENDI; ANDERSON, 2008) ainda que exista, como já referido no capítulo 1, um problema primordial na análise dos determinantes da redistribuição, uma vez que o modelo redistributivo é essencialmente estático. Como foi proposto por Bergh (2005), a política redistributiva afeta também a renda pré-tributação no futuro e não apenas a pós-tributação no presente.

Recentemente, a própria indisposição tradicional do eleitorado estadunidense às políticas relacionadas ao Estado de Bem-estar Social começou a ser dissipada com o incremento constante da desigualdade econômica no país ao longo das últimas três décadas. Com o aumento da distância entre a renda média e a renda do eleitor mediano, nos conceitos do modelo de Meltzer e Richard, o problema da desigualdade econômica deixou de ser circunscrito a certos grupos minoritários hostilizados socialmente e passou a ser temática central no debate político nacional. Esse fenômeno é exemplificado no discurso do Presidente Barack Obama ao Congresso americano em janeiro de 2014, no qual o tema da desigualdade foi o foco central da mensagem (BAKER, 2014)[32].

---

reduziu-se, coincidindo com o crescimento da percepção de que rendimentos elevados eram oriundos de corrupção e outros processos injustos (GROSFELD; SENIK, 2010).

[32] Em 2012, pela primeira vez uma espécie de proteção universal pública no campo da saúde foi aprovada, indicando que o tema da desigualdade social começou a ganhar fôlego em decorrência do agravamento da crise econômica e também do aumento da celeridade do crescimento da desigualdade. Outro

Além de a competição eleitoral ser aberta a diferentes clivagens, a própria economia política da redistribuição dos recursos dentro de uma dada sociedade é multidimensional. Isto porque a decisão do esforço de redistribuição de renda ativa múltiplas clivagens sociais que são distintas da mera diferenciação de rendimentos entre as classes baixas, medianas e altas. Por exemplo, a política redistributiva pode incluir argumentos em defesa ou contrários ao aumento das despesas que sejam motivadas por questões raciais, de gênero, renda ou relações de centro e periferia. E conforme demonstrado por Roemer (1998) o sucesso da temática redistributiva está associado com a sua ortogonalidade em relação a outras clivagens que dividem o eleitorado.

Alesina, Bair e Easterly (2000) mostraram, inclusive, que dentro dos Estados Unidos a demanda por redistribuição em cada cidade é afetada pela extensão da fragmentação etnolinguística da população. Retornando a Gilens (2009), o autor mostra em seu argumento que parte da população estadunidense considerava – durante os anos 1990 – que o segmento social receptor de benefícios da política social era composto majoritariamente por aqueles que não assumiam a responsabilidade pelo próprio aperfeiçoamento pessoal e que não deveriam se fiar no apoio governamental. Sublinhavam ainda que as políticas de proteção social colocavam um peso desnecessário nas costas da classe média pagadora de impostos.

De maneira geral, os estadunidenses não defendiam a ampliação de políticas de bem-estar social, pois acham que

---

elemento que indica a crescente importância da temática da desigualdade no debate político estadunidense é o papel ocupado pelo movimento *Occupy Wall Street* e seu slogan: *We are the 99%* (PIKETTY, 2014).

esses programas apoiariam os pobres indignos do apoio do estado. E a percepção a respeito de quem seriam os pobres indignos possuía dois componentes básicos: a maior parte dos receptores dos benefícios seriam os negros e a opinião pública tem a percepção de que os negros são menos comprometidos com a ética do trabalho do que os outros estadunidenses. Existia, portanto, uma percepção generalizada de que o bem-estar tornou-se uma palavra código para raça. Gillens conclui que a oposição à ampliação das políticas redistributivas estava mais associada ao problema racial do que a própria antipatia do eleitorado à redistribuição.

Em outro corte teórico, Thomas Frank (2007) analisa essa questão da multidimensionalidade da política democrática ao discutir como a dimensão dos valores sociais no interior dos Estados Unidos (debate que perpassa questões como a permissão do aborto e do casamento homoafetivo e políticas migratórias) se sobrepõe aos interesses econômicos do eleitor médio. Segundo o argumento do autor, o conservadorismo na dimensão dos valores sociais é proeminente ao passo que a dimensão econômica é deixada de lado. Assim, o interior dos Estados Unidos se mantém fortemente republicano, mesmo que as políticas econômicas defendidas pelo Partido Republicano tenham prejudicado o eleitor decisivo dessa região.

Robinson (2009) discute esse ponto e o apresenta como um dos principais problemas dos modelos redistributivos baseados no teorema do eleitor mediano. Para o autor, a inclusão de novas dimensões do debate político permite o surgimento de clivagens transversais que reduzem a demanda por redistribuição por parte da cidadania. Assim, dada a multidimensionalidade da competição política, as previsões do modelo redistributivo do eleitor mediano tornam-se nebulosas. Isto

porque os cidadãos possuem diferentes interesses em jogos na definição de qual deve ser a política pública a ser adotada, produzindo uma gama variada de preferências sobre essa temática, inclusive em alguns momentos defendendo posições políticas sobre assuntos que tem como consequência reduzir o seu próprio rendimento econômico final (BARTELS, 2008).

Beramendi e Anderson (2008) resumem esta questão:

> Nossa habilidade para entender os aspectos intrincados das políticas distributivas aumentam uma vez que mais dimensões são incorporadas no modelo. Exemplos disso incluem o enigma de porque os pobres não expropriam os ricos em regimes democráticos (ROEMER, 1999; 2009), o papel da renda, aversão ao risco e habilidades específicas dos cidadãos alterando suas preferências pela redistribuição da renda do trabalho (IVERSEN; SOSKICE, 2001; MOENE; WALLERSTEIN, 2001) e dos empregadores (SWENSON, 2002; MARES, 2003); e a interação entre raça e as preferências por redistribuição de diferentes grupos de renda (AUSTEN-SMITH; WALLERSTEIN, 2003; ALESINA; GLAESER, 2004). (BERAMENDI; ANDERSON, 2008, p. 10).

Partindo de percepção semelhante a respeito do problema da multidimensionalidade da disputa política democrática, Roemer (1998) propõe um modelo bidimensional entre dois partidos no qual a competição política acontece entre as dimensões redistributiva e outra qualquer, podendo ser esta conflagrada pelo tema da escravidão, integração, religião, nacionalismo ou mesmo a disputa por valores morais[33].

[33] Laver e Hunt (1992) apresentam evidências de que a política é multidimensional em um conjunto de 20 países. Kitschelt (1994) discute o fato de que nos últimos 30 anos na Europa a política pode ser compreendida como sendo bidimensional. De um lado um eixo redistributivo e do outro um eixo de valores

Ao tentar resolver o modelo n-dimensional, Roemer demonstra claramente a inexistência de um único equilíbrio na linha do modelo redistributivo de Meltzer e Richards. Ademais, além do próprio problema da dimensionalidade da disputa política, Roemer (1998) lista outras possíveis hipóteses encontradas em sua revisão da literatura que explicariam a não aplicação dos modelos redistributivos na realidade histórica contemporânea:

a) eleitores reconhecem a dinâmica adversa decorrente dos efeitos de expropriar os ricos, que possuem talentos produtivos escassos e que deixariam de ser ofertados mediante uma política tributária muito ofensiva, o que reduziria o *output* total da economia[34];
b) muitos eleitores cuja renda é menor que mediana tem a expectativa de que vão enriquecer e, portanto, defendem o seu futuro bem-estar;
c) os ricos possuem instrumentos de convencimento do resto da cidadania, disseminados por meio da mídia – controlada pelas elites econômicas, de que a redistribuição não seria boa para a comunidade política como um todo; e finalmente

entre posições mais autoritárias e posições mais libertárias, sendo que ambas dimensões tendem a ter uma relação ortogonal entre si. Por sua vez, Kalyvas (1996) e Przeworski e Sprague (1986) argumentam que entre 1880 e 1940 a política europeia teve como dimensões fundamentais a dimensão redistributiva e a dimensão religiosa.

[34] Przeworski e Wallerstein (1988) desenvolvem este problema como o poder estrutural do capital em democracias capitalistas. Existe um limite às políticas redistributivas que é não ameaçar o papel da decisão privada e descentralizada do capital sobre a taxa de investimento, o que tem consequências de médio prazo sobre o desempenho econômico afetando, assim, a sustentação política do governo de plantão.

d) os cidadãos acreditam que as pessoas ricas – e de fato todos – merecem a riqueza que possuem, e, portanto, as taxas de imposto muito elevadas seriam antiéticas.

Inclusive do ponto de vista formal, a partir da inclusão de múltiplas dimensões nos conflitos políticos eleitorais, teoristas sociais como Kenneth Arrow demonstram que regras eleitorais não ditatoriais produzem preferências coletivas irracionais, refutando, entre outras coisas, o próprio requisito da transitividade das preferências sociais coletivas. O equilíbrio do teorema do eleitor mediano supõe como hipótese que a política ocorre estritamente em uma única dimensão. Se as preferências dos cidadãos não forem unidimensionais, a regra não ditatorial não leva a nenhum equilíbrio específico, indicando claramente a irrazoabilidade das preferências coletivas na presença de múltiplas clivagens eleitorais e das próprias conclusões do modelo redistributivo (ARROW, 1963; SEN, 1970).

Por outro lado, ainda que a política não ocorra em uma única dimensão e a questão da redistribuição não possa ser considerada sempre importante, o debate democrático não é caótico, pois além das potenciais demandas gestadas no seio da cidadania, é preciso observar o lado da oferta e, logo, como os partidos enquadram em plataformas e políticas públicas as dimensões latentes da cidadania. Não há incentivo para que os partidos concorram tendo argumentos políticos elaborados para um número vasto de dimensões e clivagens sociais.

A introdução de uma gama variada de temas tende a criar dificuldades para os eleitores no processo de identificação de qual é a orientação do partido nas dimensões que lhe são mais relevantes, impondo também um custo desnecessário aos partidos derivado da necessidade de se posicionar na

discussão sobre temas que não sejam de interesse de vasto número de eleitores. Em outras palavras, os custos de fomento do debate e difusão de imagens e ideias sobre muitas clivagens podem ser maiores que os benefícios do potencial de conquista de eleitorado. Os partidos tendem, portanto, a eleger alguns temas que sejam eleitoralmente mais lucrativos dentre o conjunto de potencias dimensões que existem num dado contexto socioeconômico[35].

Posto isto, para se analisar a relação entre democracia e desigualdade é necessário levarmos em conta tanto o lado da demanda quanto o da oferta de redistribuição. Do lado da demanda é necessário analisar qual é o contexto socioeconômico no qual uma parcela majoritária da cidadania apoia a adoção de medidas redistributivas. E do lado da oferta, quando o cálculo do custo benefício da ação política sobre determinada clivagem eleitoral é favorável. Isto é, qual é cenário socioeconômico nos quais os temas redistributivos podem trazem mais votos para os partidos políticos.

É necessária uma teoria sobre qual o contexto no qual a política redistributiva está entre aquelas que são as mais demandadas pela maior parte do eleitorado e ao mesmo tempo são menos custosas para os partidos e, assim, podem ser

[35] Ademais, a própria institucionalidade do Estado moderno contemporâneo estimula que a atenção seja voltada em determinados momentos para certos assuntos em detrimento de outros problemas e conflitos sociais. Para Breunig (2011) devido a limitações cognitivas, os próprios decisores realizam uma busca ordenada entre um conjunto limitado de alternativas e avaliam sequencialmente um número finito de alternativas até que possam encontrar uma solução suficientemente boa para o problema percebido. E assim, no agregado, o modelo de decisão sugere que a maioria das mudanças é marginal e em apenas determinados momentos acontecem mudanças radicais em temas que tomam grande proeminência na ordem política do dia.

utilizados pela propaganda política e foco de políticas públicas que aumentem a probabilidade de manutenção do partido incumbente nas posições centrais de governo.

Propomos que o tema da desigualdade econômica só será demandado pela cidadania de maneira mais substantiva nos ambientes eleitorais nos quais uma considerável parcela dos eleitores for de fato sensível a essa temática. E isso ocorrerá somente quando a distância entre pobres e ricos for tão extensa que a questão da desigualdade econômica torna-se passível de ser traduzida em termos de injustiça e desequilíbrio social e não como consequência natural de outros elementos positivamente valorizados pelos cidadãos[36]. Ou seja, quando a distribuição de renda em uma dada sociedade for alvo passível de abjeção social, existindo espaço (verídico ou não) para a denúncia do uso das instituições políticas e econômicas para o benefício de certos grupos específicos em detrimento do todo social. E é plausível assumir que quanto maior for essa distância entre pobres e ricos – isto é quanto maior for a própria desigualdade econômica; maior será o potencial eleitoral da demanda por redistribuição pela cidadania, que passa a enxerga as diferenças entre pobres e ricos sob uma lente política e não apenas econômica.

Em complementação à demanda por redistribuição, a oferta também é afetada de acordo com o aumento do grau de desigualdade econômica de uma dada sociedade. O resultado líquido do cálculo de custos e benefícios eleitorais varia positivamente com a expansão do fosso social que separa os ricos

[36] Como, por exemplo, a competição via mercado em contextos políticos nos quais os cidadãos tendem a valorizar os pontos positivos das relações mercantis centradas na livre iniciativa e no retorno monetário de acordo com a produtividade individual.

dos mais pobres. O suposto subjacente a esta relação decorre do fato de quanto maior for a desigualdade econômica dentro de uma dada sociedade e mais justa e livres forem as eleições, menores serão os custos que os partidos políticos enfrentam na obtenção do apoio político e também dos votos das classes menos favorecidas na distribuição de renda. Isto porque a falta de recursos desse grupo social torna necessário um menor investimento para obter o apoio político de um indivíduo desfavorecido do que o voto de alguém que pertença às classes médias e altas.

Em sociedades democráticas e desiguais, a quantidade de recursos necessários para obter o apoio das classes mais pobres é menor que os custos de atração das classes médias e altas, o que torna a primeira estratégia mais interessante dado constrangimentos naturais existente nos orçamentos partidários e governamentais. Assim os partidos políticos que ativarem o tema da desigualdade em termos de injustiça e desequilíbrio social competirão para obter os votos da base da sociedade e criarão políticas que reduzam a pobreza deste segmento, o que terá como consequência um efeito negativo substantivo no nível de desigualdade econômica.

Uma ilustração desse argumento é obtida ao se analisar os impactos positivos do Programa Bolsa Família (PBF) no cenário eleitoral brasileiro. Enquanto os benefícios são bastante reduzidos se olharmos os efeitos potenciais de aumento de renda que trariam para famílias de classe média e classe alta no Brasil, o programa foi extremamente importante na superação da pobreza familiar em redutos de miséria no Brasil. Desta forma, os grupos sociais atendidos pelo programa corresponderam eleitoralmente votando maciçamente a favor

dos incumbentes nas eleições de 2006 e 2010[37]. Os valores em 2010, ano da eleição da candidata governista Dilma Rousseff, do PBF variavam entre R$ 70,00 a R$ 230,00 e focavam, sobretudo, as famílias com renda inferior à R$ 140,00 per capita[38], o que obviamente definem valores que não trariam tantos dividendos eleitorais se fossem transferidos para famílias de classe média ou alta, que no Brasil possuem renda familiar superior à R$ 7.475,00, perfazendo 15% da população brasileira ou mesmo à classe média emergente (classe C), que constitui 60% da população brasileira e cuja renda familiar é superior à R$ 1734,00 (Neri, 2012)[39].

Diante destas ponderações, é necessário dar uma nova interpretação às implicações teóricas obtidas a partir do teorema do eleitor mediano, quando aplicado à questão da redistribuição. Diferentemente das conclusões de Downs e Hotelling de que a política majoritária é determinada pela posição do eleitor mediano, esse teorema delimita de fato o máximo potencial da força dos mais pobres dentro de uma determinada sociedade democrática. Isto porque, dada a sua pior posição na escala de renda, estes grupos possuem menos recursos econômicos per capita para serem transferidos para o campo da política. Assim, a única forma de conseguirem atingir e modificar o status quo do sistema político de fato é por meio da atuação coletiva e coordenada. E o máximo de coordenação é obtido quando todos os indivíduos abaixo da renda mediana

[37] Uma literatura relativamente desenvolvida já captou efeitos relevantes e positivos do PBF no sucesso eleitoral de Lula em 2006 (HUNTER; POWER, 2007), (NICOLAU; PEIXOTO, 2007), (ZUCCO, 2008), (LICIO; RENNÓ; CASTRO, 2009) e (CORRÊA, 2010).

[38] Ministério do Desenvolvimento Social

[39] Estimativas populacionais para 2014. Em 2003 a Classe A e B perfaziam apenas 7,6% da população. A Classe C 37.5% e as Classes D e E 55% (Neri, 2012).

votam conjuntamente para pressionar os líderes democráticos em prol de determinada pauta eleitoral.

Contudo a metade mais pobre da distribuição de renda sempre é suscetível a outras divisões decorrentes da existência de outras clivagens – étnicas, raciais ou de valores – que sejam temas importantes do debate político e que reduzam a capacidade de ação conjunta dos mais pobres como um segmento coeso e defensor da redução das disparidades econômicas.

Ademais, há vasta literatura que apresenta o papel de empreendedores políticos para a ativação de certas clivagens que rompem a unidade das populações menos favorecidas. O exemplo acima citado do estudo de Thomas Frank (2007) em sua leitura sobre a disputa eleitoral no interior dos Estados Unidos é um claro exemplo disso. Outro estudo que mostra a importância do papel do empreendedor político na ativação de clivagens sociais é o estudo de Posner (2004) no qual são discutidas as circunstâncias nas quais as divisões culturais e identitárias tornam-se salientes[40].

⁂

Dada essas ponderações é necessário rever alguns dos achados empíricos apresentados nas seções anteriores e dos

[40] Outra forma de entender as clivagens transversais que rompem a solidariedade política entre os mais pobres além do diagnóstico de Frank (2007) é o conceito de falsa consciência política adotado de longa data por teoristas políticos marxistas. No que se refere ao debate sobre o papel das clivagens identitárias, Posner (2004) usando um desenho de pesquisa quase-experimental defende a hipótese de que a saliência política das clivagens culturais não depende da própria clivagem em si, mas sim do tamanho dos grupos e se esses grupos serão uteis na competição política. Isto é, além da potencialidade divisória da dimensão identitária, é necessário que algum empreendedor político desempenhe o papel de ativador do tema no debate político-eleitoral.

próprios mecanismos teóricos sublinhados. Em toda esta literatura que discute a relação entre democracia e desigualdade econômica foi feita uma suposição, ainda não testada, de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica seriam homogêneos ao longo de diferentes contextos de desigualdade. Independente, portanto, do contexto socioeconômico no qual a competição democrática ocorre. A dimensão da desigualdade econômica sempre ocuparia o mesmo espaço político eleitoral, não havendo diferenças dos efeitos da democracia em termos de redução da desigualdade e ampliação da redistribuição em sociedades mais igualitárias ou mais desiguais.

A suposição de que a competição política democrática, no que toca aos problemas da desigualdade, ocorreria segundo padrões semelhantes ao longo de todo o contínuo de desigualdade social não parece ser crível quando levantamos o problema da multidimensionalidade da política democrática. E é exatamente sobre esta questão que nos debruçamos nessa pesquisa. Pretendemos verificar se este pressuposto é verdadeiro e para tanto analisamos a hipótese alternativa de que esses efeitos variam ao longo da distribuição de desigualdade econômica devido aos dois mecanismos complementares discutidos acima: a existência ou não da demanda por redistribuição no seio da cidadania e o cálculo eleitoral feito pelas elites políticas partidárias.

Contrário ao consenso da literatura, temos a expectativa que os efeitos da competição democrática sobre o tema da redistribuição em sociedades iguais não deve diferenciá-la de regimes não democráticos, uma vez que a desigualdade não é um tema a ser ativado pela disputa política. Nestes contextos socioeconômicos inexiste a demanda por redistribuição no

seio da população e os partidos políticos, por sua vez, não têm interesse em ativá-la, buscando obter apoio eleitoral por meio do uso de outras demandas políticas ao acionar outras dimensões ou clivagens sociais.

Por outro lado, em sociedades excessivamente desiguais os partidos políticos tendem a moldar o discurso eleitoral e as próprias políticas públicas em busca da minimização dos efeitos da desigualdade econômica, uma vez que a intensidade da demanda por redistribuição por parte da cidadania torna-se um vetor que diminui a importância de outras clivagens latentes. E os partidos políticos teriam uma maior tendência a atender a esta demanda e tratar do problema da desigualdade econômica como uma questão que excede os limites da economia de mercado, refletindo, outrossim, conceitos de injustiça e exploração social e de denúncia do uso das instituições políticas e econômicas para benefício de certos grupos privilegiados.

Assim, ao colocarmos em questionamento o pressuposto da homogeneidade dos efeitos da democracia, tentamos responder à seguinte indagação: *seriam os efeitos equalizadores de um regime político democrático em uma sociedade desigual semelhantes aos efeitos equalizadores de um regime político democrático em uma sociedade igualitária?*

Sublinhamos mais uma vez o significado que damos para o termo democracia, definido nessa pesquisa como um processo competitivo de escolha de lideranças políticas. A diferenciação de padrões recorrentes em regimes democráticos em relação a não democracia decorre, portanto, de implicações que a competição política tem para a temática em análise. Em sociedades relativamente iguais, o tema da desigualdade econômica não está entre os principais temas da agenda política da competição eleitoral. Já em sociedades relativamente

desiguais, as chances de que um dos partidos que disputam as eleições democráticas invista na temática da necessidade de redução da desigualdade, traduzindo-a em termos de injustiça e desequilíbrio, e, portanto, defendendo o imperativo moral de que é necessário reduzi-la, é maior. Posto isso, iremos verificar se os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica são condicionados às situações nas quais o tema da desigualdade pode ser ativado de maneira crível por algum dos competidores políticos.

Como foi apontado pela literatura que discute os efeitos da desigualdade econômica nos processos de democratização, uma das dificuldades de se criar uma democracia em sociedades desiguais é o temor das elites políticas e econômicas decorrente da ameaça de redistribuição que são levados em conta em seu cálculo estratégico sobre os custos de repressão e os custos de tolerância à transferência de poder às classes mais desfavorecidas (BOIX, 2003; ACEMOGLU; ROBINSON, 2006; HOULE, 2009). Desta feita, quando uma transição democrática em um país relativamente desigual é bem-sucedida, é provável que esta democracia desigual esteja associada a um processo mais efetivo de redistribuição de riqueza do que o padrão encontrado em sociedades democráticas igualitárias.

As diferenças entre os temas prioritários das agendas pós-redemocratização na América Latina e no Leste Europeu deixam indícios de que é importante diferenciar os efeitos da democracia ao longo deste contínuo da desigualdade econômica. As democracias recém-saídas da esfera de influência do sistema político soviético são bastante claras a respeito do funcionamento deste padrão de ação sobre a desigualdade. Como os regimes autoritários a partir dos quais estas democracias emergiam foram regimes que produziram níveis altos de igualdade econômica (os mais altos encontrados até agora), o tema da desigualdade não estava no topo da lista de prioridades

dos primeiros competidores políticos. Por outro lado, após a redemocratização latino-americana, que emergia de regimes autoritários que produziram níveis recordes de desigualdade econômica, como o caso brasileiro, o tema do resgate da dívida social tornou-se uma das principais bandeiras políticas, disputando espaço na agenda apenas com os debates sobre a inflação e sobre o próprio processo de redemocratização[41].

Para responder a esta questão de pesquisa iremos analisar as duas hipóteses abaixo que nos permitem explorar (a) se na média as democracias reduzem a desigualdade econômica em relação às ditaduras (H1: *hipótese tradicional da homogeneidade dos efeitos*) e (b) se os efeitos dos regimes políticos democráticos sobre a desigualdade econômica são crescentes ao longo da distribuição de desigualdade, sendo mais acentuados nas sociedades mais desiguais (H2: *hipótese da heterogeneidade dos efeitos*).

> **H1:** *As democracias possuem em média um efeito negativo sobre a desigualdade.*
>
> **H2:** *Os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade são maiores nas sociedades mais desiguais e tendem a ser menos relevantes em sociedades mais iguais.*

---

[41] O artigo de Lupu e Pontusson (2011) analisa essa questão segundo um prisma distinto, mas que converge com o argumento teórico proposto nesta pesquisa. Para ambos autores, o que afeta a economia política da redistribuição de renda é a estrutura da desigualdade. Para justificar o argumento, os autores propõem um modelo no qual o posicionamento estrutural da classe média em relação aos pobres e os ricos determina o apoio à redistribuição: "na ausência de clivagens étnicas transversais, os eleitores com renda intermediária terão empatia com os pobres e apoiaram políticas redistributivas quando a distância entre a renda média e dos pobres é pequena em relação à distância de renda entre a renda média e a renda dos mais ricos" (LUPU; PONTUSSON, 2011, p. 316).

2.2 Metodologia

Na seção anterior desenvolvemos a nossa proposta teórica e hipóteses de pesquisa. Nesta apresentamos o método que nos permitirá testar a hipótese da heterogeneidade dos efeitos da democracia sobre a desigualdade e como agiremos para superar a questão da endogenia presente na relação entre democracia e desigualdade econômica. Isto porque como já apresentado no Capítulo 1, existe uma vasta literatura que discute os potenciais efeitos negativos que a desigualdade pode trazer aos processos de democratização. A questão da presença de endogeneidade na relação entre democracia e desigualdade é fundamental, pois vasto conjunto de estudos discute a hipótese de que a desigualdade é negativamente relacionada com a probabilidade de um dado país tornar-se e/ou permanecer sendo uma democracia.

Na próxima subseção apresentamos a estratégia adotada para identificar o efeito da democracia sobre a desigualdade, controlando o problema da causalidade reversa. O método que utilizamos e justificamos abaixo é o de variáveis instrumentais. Na subseção seguinte introduzimos o método de regressão quantílica, adequado para a estimação dos efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade.

Para a identificação dos países que são democráticos, utilizamos a base sobre regimes políticos de Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010). Assumimos a mensuração dicotômica defendida pelos autores que definem democracia como um regime político no qual existe competição política por meio de eleições[42]. De maneira simplificada podemos dizer que

[42] Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010) atualizam a base de Przeworski, Alvarez, Cheibub e Limongi (2000).

consideramos como democrático todos os regimes políticos nos quais o partido incumbente deixa o poder por meio de eleições livres e justas. E para mensurar a desigualdade econômica utilizamos o conjunto de dados produzido pelo Projeto Desigualdade da Universidade do Texas (University of Texas Inequality Project - UTIP), que utiliza métodos baseados no componente entre grupos do Índice T de Theil. O banco de dados inclui 3686 pontos de dados de EHII para 145 países[43]. A unidade básica de análise é um país/ano e o banco tem o formato de um painel desbalanceado de 1963 à 2008. Apresentamos uma discussão mais aprofundada sobre as definições teóricas e metodológicas de democracia e desigualdade econômica no Capítulo 3.

2.3 Endogenia nas relações entre democracia e desigualdade econômica

Na relação descritiva entre democracia e desigualdade[44], verificamos que a democracia está associada a níveis menores de desigualdade. Contudo apenas esta informação descritiva não nos permite compreender qual é o processo causal presente nessa relação. Como existe na literatura e no próprio mundo da política a percepção de que a democratização estimularia a adoção de uma maior redistribuição de renda das elites para as classes menos favorecidas, a transição democrática é custosa para às elites econômicas. E como consequência é

[43] O banco final possui projeções lineares para reduzir o problema de dados faltantes de desigualdade econômica para intervalos de até 8 anos. O banco de dados foi ampliado para 4138 anos – países. A interpolação não é problemática dado que a variação na desigualdade é sempre bastante lenta e gradual. Ademais, os resultados são idênticos quando usamos o banco original.

[44] Apresentada no capítulo 3.

possível que exista uma resistência por parte destas elites contra avanços democráticos justamente nas sociedades que possuem uma distribuição de renda mais desigual (BOIX, 2003; ACEMOGLU; ROBINSON, 2006; HOULE, 2009)[45]. Caso tal processo realmente exista, os sistemas políticos democráticos tenderiam a ser uma seleção predileta de sociedades mais igualitárias e, desse modo, a mera associação entre democracia e desigualdade não confirmaria a hipótese de que a democracia é um regime político capaz de reduzir as desigualdades econômicas entre os indivíduos.

Para resolver o problema da endogeneidade presente na relação entre democracia e desigualdade, usaremos a técnica de variável instrumental (IV). A intuição básica subjacente à abordagem de IV é estimar a variável endógena, no nosso caso, a variável de democracia (a independente com problema de causalidade reversa), usando uma variável exógena e que seja correlacionada com a variável endógena, mas que não esteja correlacionada de nenhuma outra forma com a variável dependente, em nosso caso, a desigualdade econômica. Desta forma, quaisquer efeitos da variável instrumental sobre a variável dependente seriam canalizados única e exclusivamente por meio da variável endógena (ANGRIST; KRUEGER, 2001; ANGRIST; PISCHKE, 2008)[46]. Isto é, devemos encontrar uma variável que não seja relacionada com o nível de desigualdade

---

[45] Boix (2003) demonstrou que altos níveis de desigualdade podem prejudicar a democratização e a consolidação das democracias. Houle (2009) e Acemoglu e Robinson (2006) também investigaram a probabilidade de que alta desigualdade prejudique a consolidação da democracia devido às expectativas de redistribuição que existe em sociedades democráticas.

[46] A *Hipótese de Restrição de Exclusão* assume que a variável instrumental é não correlacionada com qualquer outra variável não observada que esteja correlacionada com a variável dependente.

econômica encontrada no país e nem com qualquer outro fator determinante da desigualdade com exceção apenas da variável endógena em questão: o indicador de democracia[47].

A validade da estimação por variável instrumental depende crucialmente da seleção de um instrumento adequado que satisfaça dois critérios: (a) ser correlacionado com a variável endógena; e (b) não possuir um efeito causal na variável dependente (ou, por extensão, no termo de erro da equação estimada). Estes critérios implicam que qualquer alteração na variável dependente que seja resultado de mudanças nos valores de um instrumento deve ser atribuída ao canal causal proporcionado pela variável endógena e, deste modo, livre da relação que existe entre a variável dependente e a variável endógena (SAVUN; TIRONE, 2011).

Nesta pesquisa selecionamos alguns potenciais instrumentos de democracia usados na literatura comparada e também propomos outras variáveis instrumentais. A partir desta seleção, analisamos e testamos quais são aqueles instrumentos que atendem aos dois critérios. Para a seleção destes potenciais instrumentos utilizamos duas abordagens distintas: a) variáveis utilizadas na literatura sobre democratização e que não são consideradas potenciais fatores causais da desigualdade; b) variáveis completamente exógenas aos processos de democratização e desigualdade econômica, mas que estão empiricamente relacionados com democracia.

Desta seleção, apresentamos três diferentes conjuntos de instrumentos para estimar o verdadeiro efeito da democracia na desigualdade. O primeiro é composto de um conjunto de

[47] Para uma apresentação mais pormenorizada do método de variável instrumental vide apêndice A.

variáveis relacionadas aos processos de difusão de democracia, tendo em vista a vasta literatura que discute os efeitos que o aumento do número de democracias no mundo tem sobre a permanência de regimes políticos autoritários e democráticos. E por outro lado, até onde sabemos, não existem trabalhos que apontem uma relação entre os efeitos da difusão de democracia pelo mundo e a desigualdade econômica dentro de um determinado país. Contudo, este conjunto de instrumentos não possui uma natureza completamente exógena ao mundo da política. O mesmo acontece com o segundo instrumento, *herança colonial britânica*.

O terceiro conjunto é composto por variáveis que captam o posicionamento longitudinal de um país no planisfério. As duas variáveis utilizadas para captar esse fenômeno são por definição estritamente exógena à relação entre democracia e desigualdade, uma vez que o posicionamento longitudinal de um país é um dado independente de sua conformação política e social e também não existem estudos ou teorias, até onde pudemos verificar, que relacionem o posicionamento longitudinal de um país com a sua desigualdade econômica.

No Quadro 1 listamos os potenciais instrumentos de democracia que foram selecionados para analisar o impacto desta sobre a desigualdade econômica. Da lista dos instrumentos que mensura o fenômeno da difusão de democracia, os três primeiros são instrumentos que diferem pelo âmbito geográfico, respectivamente no mundo, no continente e no subcontinente, e os dois seguintes são medida resumo das três variáveis anteriores. Já a variável herança britânica é um indicador da existência ou não de alguma herança colonial britânica no país, incluindo o próprio Reino Unido. Além das colônias britânicas, são considerados como parte deste conjunto os

países que foram colonizados pelas ex-colônias britânicas EUA e Austrália.

Quadro 1 – Instrumentos de democracia

1) Instrumentos de Difusão:
a) Difusão mundial de democracia: número de democracia existentes no ano / número de países existentes no ano. [**difmundo**]
b) Difusão continental de democracia: número de democracia existentes no continente no ano/número de países existentes no continente no ano. [**difcont**]
c) Difusão subcontinental de democracia: número de democracia existentes no subcontinente no ano/número de países existentes no subcontinente no ano. [**difregiao**]
d) Difusão ponderada de democracia: média simples das medidas (a); (b) e (c) [**difpond1**]
e) Difusão ponderada de democracia dado a relevância regional e continental do país: média de (a), (b) e (c), ponderada pelo peso territorial do país no continente e no subcontinente, respectivamente [**difpond2**]
2) Herança Britânica: indica se o país possui herança britânica, incluindo o próprio Reino Unido e ex-colônias americanas e australianas, adaptado de Hadenius e Teorell (2005) **[british]**
3) Localização Longitudinal: **a) Hemisférico Oriental:** indica se o país possui localização longitudinal ao oriente do meridiano 36º (Turquia). [**horiental**] **b) Longitude:** log da longitude de um país calculado por 105+longitude. **[llong]**

O terceiro e último conjunto de instrumentos são estritamente exógenos, pois mensuram de diferentes formas o posicionamento longitudinal de um país. Contudo, se espera que a relação com democracia seja mais fraca. Mensuramos a localização longitudinal com um indicador se o país está localizado na fração oriental do planisfério, sendo a linha divisória traçada no meridiano 36º Leste, que divide o

continente europeu do continente asiático[48]. O segundo é a própria transformação logarítmica da longitude do país. Optamos pela transformação logarítmica de forma a reduzir a influência de alguns poucos casos específicos do continente da Oceania que possuem valores absolutos longitudinais muito superiores ao restante da amostra[49].

2.3.1 Difusão democrática como instrumento de democracia

No primeiro conjunto de instrumentos estão as medidas da difusão de democracia. Como uma importante literatura sobre as transições políticas mostrou, um dos importantes componentes do processo de democratização é a atmosfera política internacional (WEJNERT, 2005; BRINKS E COPPEDGE, 2006; GLEDITSCH; WARD, 2006; MAINWARING; PÉREZ LIÑÁN, 2009). Todos estes autores defendem a ideia de que existe algum mecanismo de difusão ou contágio por meio do qual os regimes democráticos são propagados. Isto porque os processos de democratização e transições autoritárias se agrupam no tempo e no espaço, sugerindo a ocorrência de uma difusão e da existência de dependências transfronteiriças que influenciam o desenvolvimento e persistência das instituições políticas (NOGUEIRA, 2011).

---

[48] O meridiano 36L atravessa a Rússia europeia, a Ucrânia, o interior da Turquia, o Oriente Médio, passando pela Síria, Jordânia e Arábia Saudita e no continente Africano atravessa o Chifre da África cortando o Sudão, Etiópia e Quênia e ao sul atravessa Tanzânia e Moçambique. Destes países a Turquia, Ucrânia, Sudão, Tanzânia e Moçambique estão no hemisfério ocidental. Os outros são considerados como localizado na esfera oriental.

[49] A Oceania é o único continente que possui longitude superior a 138, sendo que a variação longitudinal nesse continente é entre 133 a 179.15.

Bunce e Wolchik (2006) definem difusão como um processo no qual ideias, instituições, modelos de políticas públicas, ou repertórios de comportamento se propagam de um centro geográfico para outras regiões. Mas o processo de difusão não requer apenas a existência de desdobramentos similares, pois exige também o reconhecimento de um novo elemento em um determinado país A por atores externos em B e um compromisso por indivíduos e grupos de B para emulá-lo em sua própria localidade.

Além da associação positiva com democracia, para que o instrumento cumpra com sua função metodológica, é necessário, portanto, que seja verdadeira a hipótese de que a variável difusão de democracia não possui outro canal por meio do qual os seus efeitos sobre a desigualdade sejam transmitidos, além do próprio mecanismo da competição eleitoral em regime democrático.

Do ponto de vista da literatura, podemos frisar que até onde pudemos encontrar informações, não há discussão sobre qualquer influência da difusão de democracia no mundo sobre a desigualdade econômica dentro de cada um dos países. Desta forma, podemos assumir que quaisquer efeitos que sejam estimados por meio da técnica de variável instrumental podem ser atribuídos ao efeito da democracia sobre a desigualdade, purificado dos problemas de causalidade reversa. Além do mais, no capítulo 4 realizamos alguns testes estatísticos que comprovam a adequabilidade do instrumento, aumentando nossa confiança neste pressuposto.

O argumento subjacente ao efeito democratizante da difusão decorre do suposto de que com o aumento no número de democracias ao redor de um país A, o grupo político que defende a democratização neste país (ou que defende a

manutenção da democracia) é empoderado. Ideias, modelos e afins podem se espalhar para além das fronteiras, simplesmente por fornecerem precedentes atraentes para os atores em A, influenciando o pensamento, objetivos e comportamento de lideranças (BUNCE; WOLCHIK, 2006). Do outro lado, não existem indícios de um canal de covariação da difusão de democracia no sistema internacional com a desigualdade econômica interna de um dado país que não seja, necessariamente, transmitido pelos próprios efeitos da competição política democrática.

Do ponto de vista prático, iremos mensurar a difusão de democracia em três diferentes proporções: uma proporção em nível regional, outra em nível continental e a terceira em nível global. Para realizar esse cálculo dividimos o mundo em cinco continentes distintos e dez subcontinentes. Os cinco continentes são: 1. África e Oriente Médio; 2. América; 3. Ásia; 4. Europa; e 5. Oceania. E os dez subcontinentes são: 1. Europa Oriental e pós-URSS; 2. Europa Ocidental; 3. Norte da África e Oriente Médio; 4. África Subsaariana; 5. América do Norte e Central; 6. América do Sul; 7. Centro e Extremo Oriente; 8. Sudeste Asiático; 9. Ásia do Sul; e 10. Oceania. Assim, o cálculo para cada uma destas proporções é basicamente o mesmo, variando apenas a circunscrição geográfica:

$$\mathrm{Dif}_{it} = [\frac{D_t}{\mathrm{N}_t}] \quad \text{(Eq. 2.1)}$$

no qual D_t representa o número de democracias no ano t na região, continente ou em todo mundo e N_t representa o número total de países neste mesmo ano t na mesma circunscrição

geográfica, sendo que para ambos os termos da proporção não contabilizamos na contagem de países e democracias o próprio país.

Além das três proporções puras de difusão, também criamos duas medidas resumos de difusão. Na primeira calculamos a média simples das três diferentes proporções da Eq. 2.1 de cada país e na segunda ponderamos as proporções regionais e continentais pelo espaço territorial ocupado pelo país na região e no continente, respectivamente. Abaixo apresentamos as duas fórmulas:

$$\text{Difpond1}_{it} = [\frac{D_{1t}}{\text{N}_{1t}} + \frac{D_{2t}}{\text{N}_{2t}} + \frac{D_{3t}}{\text{N}_{3t}}] \Big/ 3 \qquad \text{(Eq. 2.2)}$$

i) *Difusão Ponderada de Democracia:* Onde D_1 é o número de democracias no mundo no ano t e N_1 é o número de países no mundo no mesmo ano t; D_2 é o número de democracias no continente do país i no ano t e N_2 é o número de países no continente do país i no mesmo ano; D_3 é o número de democracias no subcontinente do país i no ano t e N_3 é o número de países na região (ou subcontinente) do país i no mesmo ano.

$$\text{Difpond2}_{it} = [\frac{D_{1t}}{\text{N}_{1t}} + \frac{D_{2t}}{\text{N}_{2t}} * (1 - \frac{\text{A}_t}{C_i}) + \frac{D_{3t}}{\text{N}_{3t}} * (1 - \frac{\text{A}_t}{R_i})] \Big/ 3 \qquad \text{(Eq. 2.3)}$$

ii) *Difusão Ponderada de Democracia dado a relevância regional e continental do país:* onde repete-se as medidas do item anterior e acrescentamos: A_t - a área territorial do país no ano *t;* C_i - a área do Continente onde o país *i*

está localizado e R - a área da Região onde o país *i* está localizado. Obviamente a medida de A_t tende a ser estável na maior parte do tempo, mas em alguns casos excepcionais certos países, como o Paquistão, tiveram seu território reduzido.

Na Tabela 1 apresentamos as correlações entre as cinco variáveis que mensuram a difusão de democracia, mais o próprio indicador de democracia mensurado por Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010). Além das duas medidas ponderadas de difusão (Difpond1 e Difpond2), incluímos as três variáveis puras que mensuram a difusão de democracia no mundo (Difmundo), no continente (Difcont) e na região (Difregião). Com exceção das correlações de Difmundo com as outras variáveis, inclusive as próprias variáveis de difusão e de apenas 0.20 com o indicador de democracia, todas as outras correlações são bastante altas[50].

Constatações interessantes podem ser obtidas a partir desta tabela de correlações. A principal constatação é que difusão mundial de democracia (difmundo) é menos correlacionada com todas as outras variáveis, incluindo o próprio indicador de democracia. Já o instrumento difusão regional de democracia (difregião) possui a maior correlação com democracia e com os dois índices de ponderados difusão, o que aponta para o fato que o processo de difusão tem o seu efeito principal nas regiões e continentes e não sobre todo o globo. E as correlações de difusão continental de democracia (difcont) estão em um ponto intermediário entre as de

[50] Adiantando resultados apresentados mais a frente, os testes estatísticos do capítulo 4 indicam que a identificação de democracia é realizada com mais acurácia nos modelos nos quais introduzimos as variáveis puras de difusão de democracia ao invés das variáveis ponderadas.

difmundo e difregião. Estes dados indicam que o processo de difusão de democracia é um fenômeno mais sensível regional do que globalmente, o que é um achado esperado uma vez que os processos de mútua interdependência são muito mais comuns entre países que se localizam em regiões próximas do que entre países que possuem uma distância geográfica maior.

Tabela 1 – Correlações entre democracia e difusão de democracia

	Democracia	$Difpond_1$	$Difpond_2$	Difmundo	Difcont
Difregiao	0.61	0.95	0.93	0.33	0.86
Difcont	0.54	0.95	0.92	0.39	
Difmundo	0.20	0.52	0.52		
$Difpond_2$	0.57	0.98			
$Difpond_1$	0.59				

Fonte: Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010) - CGV

Finalmente, o instrumento que mensura a *herança colonial britânica* é retirado da literatura de política comparada. Em Eichengreen e Leblang (2008) a herança colonial britânica é usada como instrumento para estimar os efeitos da democracia sobre a globalização, mensurada como o nível de abertura comercial, num cenário que de acordo com os autores também sofre do problema de causalidade reversa[51].

Na Tabela 2 apresentamos as correlações entre os outros três instrumentos selecionados e democracia. Podemos

[51] Outras variáveis utilizadas como potenciais instrumentos de democracia por Eichengreen e Leblang (2008) foram o número de anos desde a independência do país usadas também por Persson (2005), Mobarak (2005) e Acemoglu, Robinson e Yared (2008); a origem legal do sistema jurídico do país; e a distância média do país das outras democracias do sistema internacional (MOBARAK, 2005; PERSSON; TABELLINI, 2006; ACEMOGLU et al., 2008; EICHENGREEN; LEBLANG, 2008).

observar que as correlações são menores do que as encontradas com os instrumentos anteriores. E praticamente não existe correlação entre a *herança colonial britânica* e o indicador de democracia, o que vai na contramão da literatura comparada e é um resultado que se mantém consistente nas análises do capítulo 4. Já as correlações do indicador hemisférico e da longitude são maiores e semelhantes entre si, indicando que estar na parcela ocidental do mundo está empiricamente associado com democracia enquanto o oriente é mais associado a regimes não democráticos. No capítulo 4 apresentamos os testes que avaliam quais destes instrumentos são adequados para identificar a relação da democracia sobre a desigualdade.

Tabela 2 – Correlações entre democracia e os outros instrumentos

	Democracia
British	0.03
Hemisfério Oriental	-0.20
Longitude	-0.20

Fonte: CGV

Por meio dos testes de Stock, Wright e Yogo (2002) demonstramos no Capítulo 4 que os instrumentos de difusão de democracia e os indicadores longitudinais são os instrumentos mais adequados para identificar democracia, enquanto a herança colonial britânica não está correlacionada com democracia, não atendendo a um dos critérios fundamentais da estimação por variável instrumental – a correlação entre o instrumento e a variável endógena. Por fim, nas principais especificações os instrumentos de difusão e de longitude atendem também aos requisitos exigidos pela hipótese de restrição de exclusão.

2.3.2 Estimação dos efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica

Conforme apresentamos na secao 1 deste capítulo pretendemos analisar duas hipóteses rivais sobre os efeitos da democracia na desigualdade econômica. A primeira hipótese, tradicional, busca avaliar se *as* **H1** - *as democracias possuem em média um efeito negativo sobre a desigualdade*. Já a segunda hipótese, a hipótese alternativa, busca inserir na discussão a questão da multidimensionalidade do conflito político e as condições e contextos nos quais existem incentivos para que surja no seio da população uma demanda por maior redistribuição e os partidos políticos atendam a esta demanda oferecendo uma plataforma eleitoral e políticas públicas que tenham como objetivo principal a redução da desigualdade econômica: **H2** - *os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade são maiores nas sociedades mais desiguais e tendem a ser menos relevantes em sociedades mais iguais.*

É necessário, portanto, adotar um método de estimação flexível o suficiente para estimar os efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica ao longo da própria distribuição da desigualdade, uma vez que queremos testar a hipótese de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são maiores nas democracias mais desiguais. O método mais adequado para responder a esse problema de pesquisa é o arcabouço de *Regressão Quantílica* desenvolvido por Roger Koenker e Gilbert Bassett (1978).

Sublinhamos mais uma vez que essa questão de pesquisa e a abordagem teórica proposta ainda não foram discutidas em nenhum dos estudos da literatura de econômica política comparada sobre desigualdade econômica. Todas as pesquisas

anteriores trabalharam com hipóteses que assumem que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são homogêneos. E na maior parte das vezes foram utilizados como método de inferência regressões por Mínimos Quadrados Ordinários para dados em Painel. Assim, uma das contribuições mais relevantes desta pesquisa será o exame dos efeitos de um regime político democrático ao longo de todas as diferentes magnitudes de desigualdade econômica.

A Regressão Quantílica introduzida por Koenker e Bassett (1978) é uma extensão direta da estimação clássica das médias condicionais por Mínimos Quadrados Ordinários (MQO) para estimação de modelos por funções condicionadas nos quantis. O método emprega um estimador de mínimos desvios absolutos que pode ser utilizado para estimar os percentis da distribuição condicionada. Deste modo, a Regressão Quantílica possibilita a detecção de relações causais distintas para vários pontos da distribuição de uma variável dependente. Isto porque ela fornece estimativas dos efeitos de cada covariável (variável independente de interesse e controles) ao longo de toda a distribuição condicional da variável dependente[52]. Em contraste, a regressão por MQO tradicional fornece estimativas apenas para a média condicional (BREUNIG, 2011).

Uma propriedade importante do método de Regressão Quantílica é sua robustez à presença de outliers na variável dependente, uma vez que a estimação é feita condicionada à posição do ponto dentro da distribuição da própria variável dependente. Ademais, como os dados estão estruturados em forma longitudinal, pretendemos estimar a relação entre

[52] Para uma apresentação mais pormenorizada do método de Regressão Quantílica com variável instrumental vide apêndice B.

democracia e desigualdade por meio de Regressão Quantílica com Variável Instrumental para Dados em Painel Empilhados.

O método de estimação por efeitos fixos não é adequado para a análise da relação entre democracia e desigualdade, pois 57.2% dos pontos de dados são países-anos pertencentes a países cujos regimes políticos não transitaram ao longo do período analisado. Assim o estimador de efeito fixo consideraria a permanência em um regime democrático ou em um regime autoritário durante todo o período como um efeito fixo a ser eliminado junto com a heterogeneidade específica não observada. Visando diminuir a variação dos dados, incluímos na regressão efeitos fixos continentais e em algumas estimações efeitos fixos temporais. Desta forma, eventuais especificidades regionais ou choques exógenos que tenham impactado a desigualdade são retirados na estimação dos efeitos das covariáveis.

No primeiro passo do processo de estimação, utilizamos as variáveis instrumentais para prever os valores defasados de democracia e depois, no segundo passo, estimamos por meio de uma série de regressões quantílicas a relação entre democracia e desigualdade usando o índice de GINI para desigualdade e os valores previstos no primeiro passo de democracia defasada para todos os decis da distribuição de desigualdade econômica.

Visando reduzir a necessidade de impor hipóteses adicionais para a validade das estimativas, as variâncias dos coeficientes da RQ são estimadas pelo método não paramétrico de *bootstrapping* (EFRON, 1979; EFRON, 1982; CAMERON; TRIVEDI, 2005). O método de *bootstrap* permite evitar fortes suposições paramétricas sobre a estrutura do termo de erro ou fórmulas complexas para o cálculo dos erros padrões[53].

---

[53] Foram utilizadas 1000 repetições no procedimento de *bootstrapping*. Para uma apresentação mais pormenorizada do método de bootstrap vide apêndice C.

No primeiro passo, utilizaremos como variável independente de interesse uma variável de difusão de democracia defasada em dois anos e a variável democracia defasada em um ano. Optamos por defasar a variável independente para minimizar ao máximo a possibilidade de existência de endogenia na relação de interesse. Nossa hipótese foi testada sem variáveis defasadas e os resultados continuam semelhantes. Repetimos estas estimativas em quatro amostras diferentes. A primeira é a nossa amostra completa, a segundo tem como unidade temporal básica um triênio, a terceira quinquênios, a quarta decênios e, por fim, a quinta e última intervalos temporais de 15 anos. O objetivo principal das amostras com maior intervalo temporal é minimizar o problema de dados faltantes, sendo um procedimento recorrentemente utilizado na literatura que debate a relação entre democracia e desigualdade. Em todas as estimações, os resultados são semelhantes.

Desta forma, apresentamos abaixo as regressões estimadas. Os coeficientes de interesse são os diferentes **β**2 estimados para cada decil da distribuição de desigualdade econômica. A variável de democracia está defasada em um ano e os instrumentos, quando variáveis no tempo, estão defasados em dois anos.

1) EQUAÇÃO ESTIMADA NO PRIMEIRO PASSO:

$$L.DEMO_{it} = \boldsymbol{\alpha} i + \boldsymbol{\beta} 6\ controles_{it} + \boldsymbol{\beta} 7\ L2.Instrumentos_{it} + \boldsymbol{\beta} 8\ continentes + \boldsymbol{\beta} 9\ tend + \boldsymbol{\beta} 10\ tend^2 + \boldsymbol{\pi}_{it} \quad \text{(Eq. 2.4)}$$

2) EQUAÇÃO ESTIMADA NO SEGUNDO PASSO:

Assumindo especificação linear para o τ - *ésimo quantil*:

$$Q_\tau\ [.\ |\ X = x] = \boldsymbol{\alpha} i + \boldsymbol{\beta} 1\ controles_{it} + \boldsymbol{\beta 2\ L.DEMO_{it}} + \beta 3\ continentes + \boldsymbol{\beta} 4\ tend + \boldsymbol{\beta} 5\ tend^2 + \boldsymbol{\varepsilon}_{it} \quad \text{(Eq. 2.5)}$$

No qual Q_τ $[.\,|\,\mathbf{X} = x] \equiv \frac{Inf}{q}\, \boldsymbol{P}\,(\,.\leq \mathbf{q}\,|\,\mathbf{X} = x) \geq \tau$ *sendo o τ -ésimo quantil condicionado na distribuição da variável dependente EHII.*

Assim concluímos a abordagem teórica e metodológica desta pesquisa. No próximo capítulo apresentaremos as definições de democracia e desigualdade econômica em seus pormenores e os dados descritivos da relação de interesse. Por fim, nos dois últimos capítulos apresentamos os resultados empíricos da análise proposta.

Democracia e desigualdade: dados e relação descritiva

Este capítulo está dividido em 5 seções e nele iniciamos a análise empírica da relação entre democracia e desigualdade. Nas duas primeiras seções apresentamos os conceitos a partir dos quais definimos e mensuramos democracia e desigualdade. Na terceira seção apresentamos os dados descritivos da relação entre estas duas variáveis. Um importante achado é que no período histórico abrangido pelos dados – entre os anos 1960 e a primeira década do século XXI – o usual diagnóstico sobre o crescente e preocupante avanço da desigualdade econômica pelo mundo, tão debatido na literatura contemporânea, não encontra respaldo nos dados, ainda que seja possível observar um abrupto crescimento da desigualdade entre as democracias consolidadas e mais desenvolvidas a partir da década de 1980[54].

Na quarta seção apresentamos novas informações descritivas e discutimos a relação entre democracia e desigualdade em uma visão de longo prazo, iniciada ainda no século XIX. Nesta visão de longo prazo, apresentada no Gráfico 12,

[54] Um pequeno crescimento da média da desigualdade econômica entre os países entre 1970 e 2005 é indicado no Gráfico 6, enquanto no Gráfico 7 há uma singela tendência decrescente para o mesmo período.

fica claro que houve uma forte redução da média de desigualdade econômica entre os países na 1º metade do século XX, acompanhado de uma reversão desta tendência com crescimento até 1990, ainda que este aumento seja menos abrupto do que a queda anterior. Obviamente um problema inerente ao esforço empírico de tratar de dados econômicos que voltam tanto no tempo decorre do fato que as mensurações de desigualdade são menos válidas e confiáveis do que os dados mais recentes, obtidos por meio de metodologias modernas como, por exemplo, surveys de renda. Por fim, na quinta e última seção apresentamos os dados das variáveis controles utilizadas na pesquisa e concluímos o capítulo.

3.1 Dados e definições de democracia

Nesta pesquisa trabalhamos com o conceito dahlsiano de que democracia é o regime no qual os governos perdem eleições livres, competitivas, certas e justas e deixam o poder, dando espaço político para a oposição. Em outras palavras, é o regime político no qual existe competição entre os diferentes atores que possuem interesses em acessar e ocupar os *loci* institucionais de poder. E esta competição é realizada dentro de uma arena institucionalizada e com regras que são respeitadas por todos os jogadores. Aqueles que detêm o poder momentâneo são obrigados por essas próprias regras a entregar o poder político a outro grupo caso o último seja vitorioso nas eleições.

Abstemo-nos de qualquer tipo de discussão conceitual a respeito de se o conteúdo do termo democracia deve indicar apenas um procedimento de escolha das lideranças políticas ou requer elementos substantivos associados aos procedimentos

eleitorais. Posto de outra forma, para os leitores que consideram a definição minimalista de democracia muito pouco exigente e entendem que este construto deveria abranger outros elementos substantivos, a nossa pesquisa tenta estimar o impacto que a competição política livre e aberta tem sobre a desigualdade econômica.

Além do debate conceitual, existem inúmeras propostas de mensuração dos regimes políticos que foram elaboradas ao longo do tempo para medir os efeitos da democracia sobre uma gama enorme de variáveis e também sobre quais são os principais determinantes dos processos de democratização e consolidação democrática. Mas, conforme demonstramos nos próximos parágrafos, a única medida que assume *ipsis litteris* a nossa definição de democracia como competição política, justificada pelas elaborações teóricas do capítulo anterior, é a concepção minimalista de Alvarez, Cheibub, Limongi e Przeworski (1996) e atualizada por Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010), de agora em diante indicada como CGV.

Existem outras duas medidas de regime político largamente utilizadas na literatura: a medida elaborada pela Freedom House (FH) sobre direitos políticos e liberdades civis (BOLLEN, 1980) e a medida do POLITY IV sobre características diversas dos regimes políticos (MARSHALL et al., 2002). Essas três medidas cobrem um grande número de países ao longo de um extenso número de anos. Mas, segundo os próprios Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010), se diferem em três características fundamentais, que justificam a nossa opção pelo CGV. As três diferenças são referentes às[55]:

[55] Apresentamos brevemente os pontos que justificam a nossa escolha pelo CGV. Para uma análise mais pormenorizada de suas características ver

i) Diferentes concepções de democracia;
ii) Natureza do tipo de dado utilizado nos indicadores de regime político;
iii) Tipo de mensuração realizada.

No que toca à concepção de democracia subjacente ao esforço de mensuração, apenas o CGV assume uma definição estritamente procedimental e minimalista de um regime político. As medidas da FH e do POLITY IV possuem uma concepção substantiva do processo, referindo-se concomitantemente à exigência de um procedimento de escolha das lideranças por meio de eleições livres, competitivas, certas e justas e também questões de cunho extraprocedimental, como, por exemplo, a ausência de violações de direitos civis ou mesmo o respeito e responsividade do governo aos interesses dos cidadãos e/ou o controle sociopolítico do Estado. Isto é, enquanto na visão do CGV a democracia é apenas o método de escolha dos dirigentes políticos, as outras medidas entendem que a competição é necessária, mas insuficiente para definir os contornos exatos da democracia.

Como propomos que as eleições competitivas sejam o fundamento do diferencial qualitativo que justifica quando e em quais condições surgem as diferenças entre regimes políticos democráticos e não democráticos sobre a desigualdade econômica, a proposição minimalista de CGV torna-se, sem sombra de dúvidas, a mais adequada para o teste da hipótese de que os efeitos da democracia são heterogêneos. Como o FH ou o POLITY IV incluem elementos além das fronteiras eleitorais, caso optássemos por estas escalas, tornar-se-ia muito

---

Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010). Em Elkins (2000) é feita importante crítica às escolhas metodológicas do CGV.

mais difícil apontar qual é o tipo de conexão teórica entre o regime democrático e a desigualdade econômica.

O segundo ponto que embasa a nossa opção pelo CGV decorre da maior confiabilidade[56] de seus dados, pois as informações coletadas para diferenciar o que seja uma democracia de um regime não democrático são objetivas e as regras de codificação e manipulação dos dados são claras. Isto porque o CGV se baseia em eventos políticos cujas ocorrências não são difíceis de determinar, tais como a realização de eleições, a existência de mais de um partido político e mudanças partidárias na liderança do governo. Já a atribuição dos valores da FH é realizada por especialistas cuja codificação nem sempre é evidente ao usuário do banco de dados e a mensuração realizada pelo POLITY IV, ainda que objetiva, requer a observação de minúcias do dia a dia da política do país analisado.

Por fim, a mensuração dicotômica do CGV elimina as dificuldades e ambiguidades inerentes às propostas policotômicas do FH e do POLITY IV. A agregação dos indicadores destas escalas torna difícil a identificação clara de quais são os verdadeiros significados de seus diferentes pontos na escala. Por sua vez, a regra de agregação aditiva do CGV elimina a possibilidade que diferentes combinações de características institucionais e eventos políticos indiquem um mesmo valor de democracia. Posto isto, o formato policotômico trazido pelo POLITY IV e pela FH não é mais informativo, tal como à primeira vista é pensado por se aproximar mais de um contínuo de democracia. Isto porque ambas não indicam de

[56] Confiabilidade é a medida que mensura o quão os resultados de uma determinada medida são repetidos de maneira similar sob condições consistentes. Isto é, o quanto a técnica de mensuração é precisa. Quanto menor for a probabilidade de erro que a recontagem do dado pode ter, mais confiável é a medida.

maneira objetiva o que significa no mundo real o avanço em um ponto de suas respectivas escalas[57].

Desta maneira, os problemas de não classificação de regimes "intermediários" pelo CGV são minimizados, uma vez que os critérios de definição deste "tipo" de regime pelo POLITY IV e pela FH são obscuros e a partir de informações não objetivas. Ademais toda a literatura da transitologia encara a diferenciação entre um regime autoritário e um regime democrático como um traço qualitativo profundo e não apenas uma gradação em uma escala imaginária de competição política.

3.1.1 Democracia como processo

A democracia é um regime no qual as posições centrais de governo são preenchidas segundo os resultados de eleições competitivas, livres, certas e justas. Esta definição possui dois elementos centrais: posições centrais de governo e competição política por meio de eleições. As posições centrais de governo são os órgãos fundamentais da vida política de qualquer comunidade política – os postos responsáveis pela criação e pela execução das leis. Assim, para um regime ser democrático é necessário que o preenchimento das posições no corpo legislativo e no corpo executivo do governo seja realizado por meio de um método eleitoral. E a competição política indica que o método eleitoral deve possibilitar a livre competição dos agentes políticos, de forma que cidadãos opositores aos que ocupam o governo possuam chances reais de tomar o poder pela via eleitoral.

---

[57] O POLITY IV mensura democracia em uma escala de 21 pontos que vão desde -10 (menos democrático) a +10 (mais democrático), enquanto a Freedom House propõe duas escalas de 7 pontos para mensurar, respectivamente, direitos políticos e liberdades civis.

As eleições necessitam de 3 condições fundamentais para cumprir com seu papel de mecanismo competitivo de definição das posições centrais do governo: i) incerteza *ex ante* de quem seja o vitorioso; ii) irreversibilidade *ex post* do resultado; e iii) repetitividade das eleições. Estas três características fundamentais determinam se as eleições são competitivas, livres, certas e justas. Isto porque a condição **i** indica que o jogo político é aberto e seus resultados não são pré-definidos. A condição **ii** indica que não é possível que o governo reverta uma eleição perdida, fraudando ou anulando uma vitória da oposição. E, por fim, a condição **iii** indica que o jogo eleitoral repete-se ao longo do tempo, impedindo que apenas um grupo tenha o seu poder congelado, além de abrir a possibilidade para que o perdedor trabalhe com a expectativa de que é possível esperar as próximas eleições para reverter numa batalha eleitoral futura a competição política perdida no presente.

Para operacionalizar empiricamente essa definição procedimental e minimalista de democracia são estabelecidas por Alvarez, Cheibub, Limongi e Przeworski (1996) e repetidos por Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010) quatro critérios objetivos. Caso um desses não seja atendido, o país é considerado como não democrático naquele ano.

1. Chefe do Executivo escolhido por meio de uma eleição popular ou por um corpo eleitoral eleito popularmente;
2. Legislativo eleito popularmente;
3. Mínimo de dois partidos competindo nas eleições;
4. Alternância de poder dentro das leis eleitorais nas quais a competição política ocorre.

As eleições que ocorrem em sistema unipartidário não são consideradas eleições democráticas, assim como as eleições que ocorrem de maneira aparentemente aberta, mas

cujos resultados foram ignorados pelo governo no momento no qual o partido de sustentação do Poder Executivo perdeu apoio eleitoral. A implementação da regra da alternância no poder busca eliminar a possibilidade de se considerar erroneamente regimes autoritários com algum grau de competição eleitoral como um regime democrático de fato. Contudo, inevitavelmente esta regra da alternância produz um erro de mensuração esperado: ela não diferencia os regimes políticos que terão alternância de poder no futuro daqueles que o governo fraudará ou anulará as eleições caso a oposição política seja vitoriosa nas urnas. A opção do CGV nesses casos foi assumir uma posição mais conservadora face aos dados e indicar que esses dois tipos de situação configuram regimes não democráticos, corrigindo os dados apenas no momento em que a oposição obtém sua primeira vitória eleitoral e a história demonstra cabalmente se a regra eleitoral é ou não violada.

3.1.2 Uma medida alternativa de competição política

Descartamos de maneira peremptória o uso da escala elaborada pela Freedom House, pois além de ser pouco clara e muito subjetiva em sua métrica de mensuração, a concepção de democracia adotada pela instituição se afasta da definição minimalista que utilizamos nesta pesquisa. A FH compreende que democracia abarca mais elementos do que a mera existência de eleições livres, competitivas e justas, embora não fiquem claros quais são os conceitos substantivos tratados como mais caros na concepção de democracia da instituição. Por outro lado, ainda que o POLITY IV seja uma escala de democracia que também exija qualidades substantivas, ele é composto pela agregação de uma série de subescalas que mensuram diferentes

atributos de um regime democrático. Estas, por sua vez, são avaliadas em critérios objetivos, estando as mensurações de suas subescalas disponíveis e desagregadas para um uso mais parcimonioso dos dados.

A escala final de democracia-ditadura no POLITY IV é uma escala aditiva de 21 pontos derivados de 5 subescalas originárias: a) *competitividade da participação política;* b) *abertura no recrutamento do Poder Executivo;* c) *competitividade no recrutamento do Executivo*; d) *constrangimentos ao Chefe do Executivo; e*) *regulação da participação.*

Dentre estas cinco, as duas mais adequadas para a discussão de nosso objeto de pesquisa são a primeira, **competitividade da participação política**, e a terceira, **competitividade no recrutamento do Executivo**, pois ambas mensuram importantes facetas do fenômeno político que tentamos contemplar na pesquisa: a existência de projetos políticos competitivos que concorrem pela aprovação da população por meio de eleições.

Nas próprias palavras dos organizadores do POLITY IV, a subescala de competitividade da participação mensura: "a extensão em que preferências alternativas por políticas e por lideranças podem ser perseguidas na arena política" (MARSHALL; JAGGERS; GURR, 2011, p. 26). Já a subescala de competitividade do recrutamento do Executivo é definida como:

> A extensão em que os mecanismos de progresso profissional dão aos subordinados chances iguais de se tornarem mandatários. Por exemplo, a seleção do chefe do executivo por meio de eleições populares entre dois ou mais partidos ou candidatos viáveis é considerada como competitiva. (MARSHALL; JAGGERS; GURR, 2011, p. 21).

A competitividade da participação política é mensurada nas seguintes cinco categorias (5) competitiva, (4) transicional,

(3) faccional, (2) suprimida, (1) repressiva, sendo que a **competição política competitiva** é definida como aquela na qual existem:

> Grupos políticos relativamente estáveis e duradouros que regularmente competem pela influência política no nível nacional; os grupos e coligações dominantes regular e, voluntariamente, transferem o poder central para grupos concorrentes. A competição entre os grupos raramente envolve coerção ou interrupção violenta. Pequenos partidos ou grupos políticos podem ser restringidos no padrão competitivo. (MARSHALL; JAGGERS; GURR, 2011, p. 27).

Essa definição se aproxima da ideia da natureza competitiva da competição eleitoral, uma vez que na arena eleitoral são postos em disputa diferentes projetos políticos sobre o país, incluindo a possibilidade de que estes projetos tratem de alguma forma sobre como deve ser regulada a relação entre o mercado e a desigualdade econômica.

Já a escala de competitividade do recrutamento do Executivo é mensurada nas seguintes três categorias (3) eleições; (2) dual/transicional e (1) seleção, sendo que o **recrutamento eleitoral** é definido como aquele método de escolha no qual "os chefes do executivo são tipicamente escolhidos por meio de eleições competitivas entre dois ou mais candidatos principais (as eleições podem ser populares ou realizadas por uma assembleia eleita popularmente)" (MARSHALL; JAGGERS; GURR, 2011, p. 22). Essa definição também se aproxima da ideia da natureza competitiva da competição eleitoral, uma vez que discutimos a hipótese de que as eleições livres, competitivas e justas são o principal mecanismo regulador da relação entre a democracia e desigualdade econômica.

Posto isso, propomos três outras formas de mensuração da competição política baseadas nestas duas subescalas do POLITY IV: a) classificação dicotômica na qual os regimes políticos cuja participação política é qualificada como competitiva são considerados como democrático e todos os outros são considerados como autoritários; b) classificação dicotômica na qual o método de recrutamento eleitoral dos chefes do Executivo é considerado como democráticos e todos os outros são considerados como autoritários e c) uma interação entre as duas variáveis, sendo considerado democrático apenas os regimes com participação política competitiva e recrutamento do Executivo pela via eleitoral. Denominamos a primeira variável como **Participação,** a segunda como **Recrutamento** e a terceira como **Competição.**

3.2 Dados e definições de desigualdade

Utilizamos como medida básica da desigualdade econômica nacional o Coeficiente de GINI, que é uma medida de dispersão estatística desenvolvida pelo estatístico e sociólogo italiano Corrado Gini (1912) para representar a distribuição de renda dentro de uma dada população. O GINI mensura a desigualdade entre os valores de duas distribuições de frequência, no caso a distribuição de renda e a distribuição de habitantes de um país. Um coeficiente de GINI igual a zero indica a perfeita equidade entre ambas, a renda é igualmente distribuída entre a população – todos recebem a mesma renda. Já um GINI de 1 (ou 100%) indica a máxima desigualdade entre os possíveis valores de renda – apenas uma pessoa detém toda a renda e todos os outros obtém zero. Optamos por essa

medida, pois além de ser a mais tradicional na literatura, ela também é sensível às modificações ocorridas em todo o escopo da distribuição de renda.

Existem outras medidas que mensuram diferentes aspectos da desigualdade, como, por exemplo, o papel da fração da renda que é controlada pela elite econômica. O vasto estudo de Piketty (2014) sobre o aumento da desigualdade nas economias mais avançadas baseia-se fortemente em dados a respeito do controle da renda e da riqueza dos 10% e 1% mais ricos[58]. Esta medida, que é bastante adequada para captar os efeitos do papel especial exercido pela elite econômica na economia capitalista, não é apropriada para mensurar efeitos agregados na desigualdade que ocorrem na calda direita da distribuição (entre os mais pobres e as classes medianas) e nem fenômenos relacionados à redistribuição entre os mais pobres e as classes medianas[59].

Além da definição conceitual da medida de desigualdade, outra dificuldade importante é que a própria forma de mensuração do coeficiente de GINI ainda não é um consenso na literatura. Os dados disponíveis na maioria dos casos são obtidos por meio de inúmeros e discrepantes métodos, sendo o mais comum o uso de *surveys* de renda ou consumo. Contudo mesmo nas surveys, os métodos de conceituação, amostragem, codificação e tratamento dos dados nem sempre são convergentes e consistentes ao longo do tempo e entre diferentes países. Assim, as técnicas de mensuração variaram em demasia ao longo dos eixos transversal e temporal, tornando conceitualmente

---

[58] Para uma discussão de diferentes medidas sobre a desigualdade ver (DE MAIO, 2007).

[59] Além do limite operacional decorrente do fato que tais medidas ainda não foram compiladas para um grande número de países.

inconsistentes comparações cruas. Tais atritos conceituais acabam aumentando a probabilidade de erro e enviesando as análises comparadas sobre a desigualdade econômica.

Outra dificuldade adicional decorre do fato de que boa parte das observações e medidas de desigualdade entre países e ao longo do tempo se baseiam em surveys realizadas ocasionalmente, pois poucos incluem em suas estatísticas nacionais a mensuração anual do GINI. E como os dados tem origem em surveys, não é possível recodificar e reparar possíveis defeitos originais e nem complementa-los retrospectivamente por intermédio dos mesmos métodos com os quais foram criados, uma vez que não é possível repetir as entrevistas realizadas no passado. Nas palavras de Galbratih (2012, p. 20):

> Não se pode fazer uma survey retrospectiva; não há maneira de voltar para a casa do indivíduo e perguntar qual era sua renda de cinco, dez ou vinte anos atrás. Assim, as lacunas de informações não podem ser preenchidas [...].

Diante desses enormes problemas de comparabilidade dos dados, em 1996 Klaus Deininger e Lyn Squire (1996) publicaram no *The World Bank Economic Review* um banco de dados no qual fora compilado um conjunto bastante grande de surveys sobre disparidade de renda e de gastos com indicações dos pontos de dados que atendiam a certos critérios de "**alta qualidade**", oferecendo o primeiro banco em painel e abrangente com 682 observações de países-anos desde 1947, dentre uma oferta de mais de 2600 observações de qualidade questionável[60]. Este banco foi um formidável estímulo aos

[60] Esses critérios são: cobertura abrangente de todos os tipos de renda, incluindo rendimentos em espécie e não salariais, como pensões e aluguéis; cobertura

estudos sobre a desigualdade econômica e dezenas de trabalhos passaram a usá-lo[61].

Esforços para expandir o projeto de Deininger e Squire – DS continuaram, principalmente na UNU-WIDER – *World Institute for Development Economics Research* da Universidade das Nações Unidas em Helsinki. Mesmo com a maior abrangência dos dados coletados, a estrutura metodológica manteve-se e as regras de compilação do DS permaneceram. A UNU-WIDER organizou um banco com 5314 observações de 160 países denominado como *World Income Inequality Database - WIID*. Contudo alguns pontos são repetidos para alguns países-anos e abrangem diferentes métodos e conceitos de desigualdade, não constituindo um banco de dados que possa ser usado sem um tratamento estatístico de padronização adequado.

Não obstante o crescente número de observações, a cobertura continuou esparsa e desbalanceada, com poucos dados com "alta qualidade" para boa parte do mundo em desenvolvimento. Milanovic (2002) apontou que o principal problema das medidas de desigualdade do DS e do UNU-WIDER, apesar de todas as virtudes levantadas, decorre da grande quantidade de dados omitidos e da excessiva interpolação feita nos trabalhos que o adotaram.

Atkinson e Brandolini (2001) apontaram ainda que as medidas do DS e da UNU-WIDER são baseadas em diferentes definições conceituais de renda, unidades de referência e procedimentos de pesquisa, que não podem ser totalmente

---

abrangente da população, incluindo famílias urbanas e rurais; e que tenham tido como unidade básica os domicílios (DEININGER; SQUIRE, 1996).

[61] O artigo inaugural de Deininger e Squire possui cerca de 3329 citações no Google Scholar. Acesso em: 11 nov. 2016.

reconciliados com o outro, mesmo na filtragem de "alta qualidade". Isso porque, a despeito da medida de desigualdade do DS e da UNU-WIDER seja o GINI, não existe uma base métodológica comum. Em particular, diferenças no conceito de renda, surveys de renda bruta ou líquida ou mesmo surveys de gastos, conduzidas em diferentes países e regiões, criam inconsistências que não são facilmente resolvidas.

Com isso uma mesma economia em determinado ano pode oferecer diferentes valores de GINI mensurados em uma mesma survey. O GINI pode ser calculado para a renda bruta (antes do pagamento dos impostos), renda líquida (depois do pagamento dos impostos) ou mesmo para o nível de consumo do indivíduo. Em uma sociedade cujo sistema tributário seja redistributivo, o GINI de renda bruta tende a ser maior do que o GINI de renda líquida. Ademais, devido ao fato de que as classes mais pobres consomem uma fração maior de sua renda, a diferença entre ricos e pobres tende a ser reduzida em surveys de consumo. Uma parte dos ganhos dos ricos tende a ser canalizada para investimentos e poupança e não entra no cálculo.

As medidas de renda nos EUA, por exemplo, são obtidas antes de serem taxadas, enquanto no Reino Unido analisa-se a renda líquida (após impostos e transferências). Desta forma, não é possível verificar se os resultados encontrados na literatura foram obtidos devido à existência efetiva de padrões de causa e efeito da desigualdade econômica ou estes resultados foram fruto apenas das diferenças entre as técnicas e conceitos de mensuração (ATKINSON; BRANDOLINI, 2001).

Um segundo atrito conceitual é a própria abrangência da população coberta pela medida. Isto por que algumas das medidas compiladas pelo *WIID* são coletadas apenas com a população urbana ou rural, economicamente ativa

ou com frações geográficas. Por fim, o terceiro e último grande problema que reduz a comparabilidade temporal e internacional dos dados do WIID é a unidade de referência em relação à qual é calculado o índice de GINI, podendo ser um indivíduo ou a família, e calculado em relação ao número de pessoas (*per capita)* ou ao número de adultos de uma família (*per adult).* A terceira e última unidade de referência é a unidade de assistência social, utilizada apenas na Escandinávia e na Alemanha.

O próprio manual elaborado pelo UNU-WIDER aponta: "tenha em mente que pontos de dados com definições similares não são definições automaticamente comparáveis, uma vez que diferenças de metodologia de pesquisa nas surveys podem prejudicar a comparabilidade" (UNU/WIDER-UNDP, 2007, p. 15).

Galbraith (2008) e Atkinson e Brandolini (2001) sublinham ainda outro aspecto problemático do DS e UNU-WIDER, que é a falta de ***validade de face***[62] de algumas mensurações, como, por exemplo, o fato que a Espanha aparece como um país com pequena desigualdade enquanto os países escandinavos (Suécia, Noruega e Dinamarca) encontram-se numa faixa média de desigualdade dentro da OCDE. Outro problema de validade de face é o fato de que o Reino Unido mantém-se como um país de desigualdade média, mesmo existindo uma percepção de um suposto crescimento da desigualdade econômica durante o thatcherismo. Os cinco exemplos apresentam

[62] Validade de face é um indicador subjetivo da validade de um indicador. Um exemplo claro de uma medida que viola o princípio da validade de face é um indicador do nível de desenvolvimento econômico que aponte que o Brasil é mais desenvolvido economicamente que os EUA. Obviamente é uma análise bastante imprecisa, uma vez que é possível que de fato a percepção sobre a realidade seja diferente da própria realidade empírica.

situações nas quais os índices de desigualdade apresentados pelo DS e pelo UNU-WIDER vão de encontro às percepções comuns a respeito da distribuição do coeficiente de GINI pelo mundo.

Devido a estes problemas, vamos utilizar em nossa pesquisa o conjunto de dados produzido pelo Projeto Desigualdade da Universidade do Texas (*University of Texas Inequality Project - UTIP*), um grupo de pesquisa que ao longo das duas últimas décadas tem se dedicado ao desenvolvimento de novas medidas de desigualdade econômica, usando métodos baseados no componente entre grupos do Índice T de Theil[63]. O UTIP tem como objetivo mensurar a desigualdade por meio de diversas fontes de informação, incluindo dados regionais sobre tributos, emprego e renda, censos sobre a produção manufatureira e banco de dados industriais harmonizados internacionalmente como fonte de informação dos níveis e mudanças da desigualdade econômica.

Este método desenvolvido pela UTIP não requer o uso de micro dados derivados de surveys e, consequentemente, produz como resultado uma infinidade de novas medidas da evolução da desigualdade econômica, comparáveis tanto através do tempo e entre países e que podem ser recuperadas a partir de dados agregados levantados pelos estados e seus respectivos sistemas de contas públicas no passado (GALBRAITH; KUM, 2003 e 2005; GALBRAITH, 2012).

[63] A estatística *T de Theil* é da família de medidas generalizadas de entropia sobre a desigualdade, sendo a única que pode ser exatamente decomposta. Segundo Theil, a diferença entre grupos da estatística T pode ser pensada como uma medida indireta da informação requerida para transformar probabilidades a priori em posteriores, no qual os pesos populacionais para cada grupo são a priori e a parcela de rendas posteriores (GALBRAITH; KUM, 2003; 2005; GALBRAITH, 2010).

A organização dos dados deriva da constatação de que a distribuição de ganhos é constituída em qualquer economia de um conjunto de entidades institucionais entrelaçadas formada por grupos: firmas, ocupações, indústrias e regiões geográficas[64]. Dado isso, a observação consistente dos movimentos nos ganhos obtidos em relação a estas entidades, tomadas em seus valores médios e comparado entre si, são suficientes para revelar os principais movimentos da distribuição de ganhos como um todo. E isto seria verdade, na visão do UTIP, mesmo se a cobertura não seja completamente abrangente, contanto que grupos e entidades sejam consistentes ao longo do eixo temporal.

Esses dados semiagregados são, portanto, fontes de informações fundamentais para expandir a capacidade analítica e a abrangência dos bancos de dados sobre desigualdade por dois motivos básicos. Em primeiro lugar, o conceito de desigualdade econômica subjacente a todos os pontos de dado é o mesmo – transversal e temporalmente. Em segundo lugar, é possível reestimar os pontos de dados do passado por meio da mesma técnica se existirem informações sobre esses grupos nas contas nacionais, permitindo o preenchimento de dados faltantes sem a necessidade de interpolação.

Para calcular o Índice T de Theil é necessário obter duas informações de cada grupo: sua renda total e sua população. De posse destes dados, é possível calcular duas razões fundamentais: a participação de cada grupo na população e a proporção da renda média de cada grupo em relação à renda média da população. O Índice de Theil que identifica o ***componente entre grupos*** da desigualdade por meio da somatória

[64] A única restrição para a escolha das entidades institucionais é que os grupos escolhidos sejam mutuamente exclusivos e coletivamente exaustivos.

do produto destas duas proporções multiplicado pelo logaritmo do segundo termo dos *m* grupos. A notação formal do índice é:

$$T = \sum_{i=1}^{m} \left\{ \left(\frac{p_i}{p}\right) * \left(\frac{y_i}{\mu}\right) * \ln\left(\frac{y_i}{\mu}\right) \right\} \qquad \text{(Eq. 3.1)}$$

onde $\boldsymbol{m}$ indica o número de grupos, $\frac{p_i}{p}$ é o peso do grupo na população e $\frac{y_i}{\mu}$ é a razão entre a renda média y do grupo $\boldsymbol{i}$ em relação à renda média μ de toda a população[65].

Uma propriedade fundamental do Índice T de Theil é que a partir de semiagregados harmonizados internacionalmente (mesmos setores em diferentes países e anos) e estáveis ao longo do tempo é possível construir uma série de dados sobre desigualdade a partir da mesma definição consensual. Assim, supera-se o principal defeito do DS e do WIID: a multiplicidade conceitual existente no rol de surveys compiladas como pontos de dado de alta qualidade.

Os dados da Organização das Nações Unidas para o Desenvolvimento Industrial (UNIDO) formam a base dos dados criados pela UTIP sobre a **desigualdade de pagamentos no setor industrial,** tendo mais de 3200 observações desde 1963. As estatísticas da UNIDO utilizadas pelo UTIP para calcular o Índice T de Theil sobre desigualdades salariais são duas medidas: o emprego total e o pagamento médio nominal nos setores econômicos desagregados[66]. Os dados da UNIDO são uma

[65] Devido ao termo logarítmico, o elemento de Theil (o produto de cada um dos grupos) é positivo para os grupos com renda média superior à renda média populacional e negativo caso contrário.

[66] A partir de agora denominamos o Índice T de Theil do cálculo da desigualdade de pagamentos no setor industrial como UTIP-UNIDO. Para maiores pormenores sobre os cálculos ver Galbraith e Kum (2003 e 2005).

grande fonte de informação sobre a temática, pois mensuram a distribuição de pagamentos salariais no setor industrial em diferentes categorias econômicas e de maneira harmonizada em todo o planeta, baseando-se na International Standard Industrial Classification (ISIC) organizada pela ONU (Galbraith e Kum, 2003; 2005; Galbraith, 2010).

Basicamente, os dados sobre desigualdade econômica da UTIP combinam informações obtidas a partir do Índice T de Theil sobre desigualdade de pagamentos no setor industrial do UTIP-UNIDO com as informações oferecidas pelo banco de dados de Deininger e Squire – DS sobre desigualdade econômica mensurada pelo coeficiente de GINI. A UTIP criou, desta forma, uma proxy bastante elaborada da desigualdade econômica com a combinação de informações compilados pelo DS com uma medida mais precisa (embora mais restrita) da dispersão dos pagamentos do setor industrial obtidos no banco de dados da UTIP-UNIDO. Convertem-se, assim, as medidas de desigualdade de pagamento no setor industrial em uma medida da **desigualdade de renda bruta domiciliar estimada (EHII – *Estimated Household Income Inequality*)**: um banco de dados denso, consistente conceitualmente e possuindo o mesmo formato dos GINIs compilados pelo DS e UNU-WIDER.

Assumindo que todos os erros de mensuração, exceto os causados pelo tipo de survey utilizada na coleta de dados, são aleatórios, Galbraith e Kum (2003) utilizaram um modelo de Mínimos Quadrados Ordinários (MQO) apresentado na **equação (3.2)** para estimar a desigualdade econômica. Nesta equação o GINI-DS representa a medida do coeficiente de GINI coletada por Deininger e Square (1996), α é uma constante, UTIP-UNIDO é o índice de Theil baseado na

medida da desigualdade de pagamentos no setor industrial e **X** é um vetor de condicionantes. Nesse vetor **X** são incluídas um conjunto de *dummies* refletindo as fontes de dados[67] e outras informações relevantes como a razão entre emprego industrial relacionada com a população total, o grau de urbanização e o crescimento populacional.

$$Ln\,(\text{GIN} - \text{DS}) = \alpha + \beta * Ln(\text{UTIP} - \text{UNIDO}) + \lambda * X + \varepsilon \qquad \text{(Eq. 3.2)}$$

Em seguida, o indicador de desigualdade principal, **EHII**, é definido, na forma logarítmica, como:

$$Ln\,(\text{EHII}) = \hat{\alpha} + \hat{\beta} * Ln(\text{UTIP} - \text{UNIDO}) + \hat{\lambda} * X_i{}^{68} \qquad \text{(Eq. 3.3)}$$

onde EHII significa a **Desigualdade de Renda Bruta Domiciliar Estimada**, UTIP-UNIDO é o índice de desigualdade salarial, da UTIP-UNIDO e **X** é a matriz de variáveis condicionantes. E os coeficientes estimados são termos determinísticos extraídos da **equação (3.2)**. Esta abordagem permite uma forma apropriada de extrapolação teórica e empiricamente orientada por meio da replicação dos dados da UTIP-UNIDO com as medidas estimadas de EHII (GIMET; LAGOARDE-SEGOT, 2011)[69].

---

[67] As variáveis dummies indicadoras do tipo de survey utilizado na compilação de dados do DS são três: indicador de renda bruta ou líquida, indicador de renda domiciliar ou individual, e indicador de renda ou consumo.

[68] Como a distribuição do Índice T de Theil da UTIP-UNIDO e do GINI da UNU – WIDER possuem uma distribuição log-normal, para aumentar a eficiência do modelo de regressão, as duas medidas de desigualdade estão em formato logarítmico. Assim o coeficiente é uma estimativa da elasticidade na relação entre desigualdade de pagamentos no setor industrial e desigualdade econômica.

[69] A análise da estimação em seus pormenores e os resultados podem ser vistos em Galbraith (2012, p. 81-97).

Nas palavras de um dos líderes do projeto UTIP:

> Essas medidas são amplamente consistentes com as medidas convencionais de desigualdade de renda obtidas por meio de survey ou podem ser feitas por meio de ajuste estatístico, permitindo diferenças conceituais entre salário e renda e para os diferentes tipos de desigualdade que são relatados nas pesquisas baseadas em survey (ex: renda, despesas, bruta ou líquida, domiciliar ou pessoal). (GALBRAITH, 2010).

> A vantagem é que a cobertura em termos de países e anos é muito maior e a uniformidade de método produz coeficientes que são comparáveis tanto através do tempo e quanto no espaço. O método UTIP, assim, permite a formação de conjuntos de dados em painel quase balanceados com mais de três mil observações anos-país, abrangendo mais de 160 países ao longo de três ou quatro décadas. (GALBRAITH, 2008).

Os dados da Desigualdade de Renda Bruta Domiciliar Estimada (EHII) foram amplamente utilizados na literatura sobre desigualdade. Herzer e Nunnenkamp (2011) usaram-no para analisar a relação entre desigualdade e a saúde da população. Herzer e Vollmer (2012) afirmaram que a grande vantagem do EHII é que os dados são totalmente comparáveis no espaço e no tempo e usaram-no para estimar o efeito de longo prazo da desigualdade de renda sobre a renda per capita de 46 países durante o período 1970-1995. Gimet e Lagoarde-Segot (2011), por sua vez, usaram os dados do EHII para analisar o impacto das diferentes características do setor financeiro na distribuição de renda dos países. Eles também afirmaram que o UTIP-EHII é a mais precisa e extensiva fonte de informação sobre a distribuição de renda já elaborada. Finalmente, Meschi

e Vivarelli (2009) utilizaram os dados de EHII para estimar o impacto do comércio na desigualdade de renda em uma amostra de 65 países em desenvolvimento, destacando a comparabilidade dos dados através do tempo e entre países.

3.2.1 Medidas alternativas de desigualdade econômica

Do mesmo modo que existe um vigoroso debate sobre como o fenômeno da democracia deve ser mensurado empiricamente, a literatura também diverge sobre quais são as melhores formas de medir a desigualdade econômica. O problema sobre esse conceito é ainda mais fundamental, pois a captura de uma medida fina sobre a distribuição de renda dentro de uma determinada sociedade requer grandes investimentos de recursos para a obtenção de um único ponto de dado, tal como surveys de consumo e renda.

Deste modo, nessa seção iremos introduzir outras três medidas de desigualdade econômica. Duas adotam diferentes estratégias empíricas para produzir mais dados que mensuram o mesmo conceito tratado pelo **UTIP-EHII**: o coeficiente de GINI. A primeira é o *Standardized Income Inequality Data* (SIID) de Salvatore J. Babones e María José Alvarez-Rivadulla (2007) e a segunda é o *Standardized World Income Inequality Database* (SWIID) de Frederick Solt (2009). A terceira, C*apital Shares,* captura o quanto dos recursos de um determinado país são controlados pelos detentores do capital e foi elaborada por Daniel Ortega e Francisco Rodríguez (2006). As três medidas são abrangentes temporal e transversalmente.

Temos como expectativa encontrar relações semelhantes para diferentes mensurações do GINI, uma vez que o conceito objeto da análise é a curva de Lorenz do coeficiente de

GINI e a fonte primária dos dados de desigualdades elaborados pela UTIP, pelo SWIID e pelo SIID são a mesma: a compilação feita pelo UNU-WIDER. Por sua vez, em relação à terceira medida, que foi utilizada por Houle (2009) para analisar a relação entre desigualdade e processos de democratização, as expectativas são mais incertas, uma vez que a variável captura outro aspecto da desigualdade: a divisão de recursos entre os detentores do capital e o resto da sociedade e não apenas a desigualdade no fluxo de renda e nem efeitos que acontecem ao longo de toda a distribuição de renda. Uma característica comum de todas as 4 medidas e que justifica a escolha empírica é a extensão da cobertura dos dados, abrangendo tantos países desenvolvidos quanto em desenvolvimento, em todos os continentes e por um extenso período de tempo.

3.2.1.1 Standardized Income Inequality Data (SIID) e Standardized World Income Inequality Data (SWIID)

As medidas de desigualdade econômica elaboradas pelo SIID e pelo SWIID são tentativas de melhorar a consistência e comparabilidade internacional e temporal dos dados sobre desigualdade econômica compilados pela UNU-WIDER por técnicas diferentes das utilizadas no UTIP-EHII. Os trabalhos de Babones e Alvarez-Rivadulla (2007) e de Solt (2009) tem um mesmo objetivo: padronizar os dados do WIID em uma nova variável que reduza os atritos conceituais entre os diferentes pontos de GINIs estimados. Deste modo, assim como o exercício empírico realizado pelo projeto UTIP-EHII, o SIID e o SWIID re-estimam os coeficientes de GINI do WIID para maximizar a comparabilidade dos dados, mantendo a maior cobertura possível em termos geográficos e temporais.

O SIID versão 2 possui 1218 pontos de dados estimados de GINI para 143 países entre 1960 e 1999 para a desigualdade em **renda per capita bruta da família** utilizando do arcabouço regressional de MQO para padronizar os dados do WIID após classificar conceitualmente os diferentes pontos em categorias distintas de conceitos de renda e unidades de referência (BABONES; ALVAREZ-RIVADULLA, 2007). Babones (2008) realiza uma interpolação polinomial para preencher os valores faltantes. O resultado final da interpolação, SIID versão 3, resulta em séries temporais contínuas para 134 países entre 1955 e 2005. Além do mais, esta última versão possui um indicador para informar se os dados são estimados para além ou dentro da amostra do WIID. Para os dados de fora da amostra, são repetidos os primeiros e últimos valores encontrados. Em nosso banco de dados 2302 observações do SIID versão 3 não extrapolados para fora da amostra foram imputadas[70]. Nas análises utilizaremos os dados do SIID versão 3 não extrapolados para fora da amostra[71].

Por sua vez, o SWIID utiliza-se de um algoritmo mais sofisticado para padronizar os dados do UNU-WIID (versão 2.0c), utilizando como parâmetros os dados de duas séries de desigualdade de renda elaboradas pelo *Luxembourg Income Study* (LIS) [72], desigualdade bruta e desigualdade líquida, e

[70] Não pudemos inserir todos os dados do SIID, pois alguns pontos de dados desse banco não são países independentes como, por exemplo, Hong Kong e Porto Rico.

[71] Agradecemos a gentileza dos professores Salvatore Babones e María Alvarez-Rivadulla por terem nos fornecido os dados das versões 2 e 3 de SIID.

[72] O LIS possui o maior banco de dados comparável sobre desigualdade ao utilizar a mesma metodologia de survey em diferentes países e anos, mas a sua cobertura temporal e internacional é bastante limitada. Seus dados cobrem os 30 países mais ricos do mundo e seus dados estão disponíveis apenas a partir de 1993.

regressões não paramétricas para a interpolação e padronização dos dados da UNU-WIDER. O primeiro passo da padronização do SWIID foi eliminar as observações que não cobrem toda a população de um país, tal como feito por Babones e Alvarez-Rivadulla (2007) na elaboração do SIID e incluir as variáveis de desigualdade de renda líquida e bruta do LIS, que são para Solt (2009) os dados melhor comparáveis sobre desigualdade e servem, portanto, de ***baseline*** para o algoritmo de padronização dos dados.

Em seguida, os dados foram organizados de acordo com 21 categorias empíricas decorrentes de combinações das cinco unidades básicas de referência e dos quatro conceitos de renda existentes no WIID[73], mais as duas categorias básicas do LIS: rendas líquidas e brutas familiares adulto-equivalentes, consideradas como grupos distintos[74]. Assim foi formado um novo banco de dados com a unidade básica de análise sendo o país/ano/categoria de renda e unidade referência. A partir destes dados foi calculada para cada país/ano a razão entre as categorias, o que permite a extrapolação dos dados para os anos nos quais algumas das categorias estão ausentes.

Um suposto assumido é que estas razões são estáveis no médio prazo, sendo possível usar a razão encontrada em um ano mais próximo para estimar o dado faltante. Com isso em mente, para os países com dados suficientes foram realizadas regressões não paramétricas (LOESS), incorporando o máximo

[73] Unidades de referência no WIID: familiar per capita; familiar adulto equivalente; familiar; por empregado; e per capita. Conceitos de renda no WIID: renda líquida; renda bruta; consumo; e não identificada.

[74] A escala família equivalente é o resultado obtido pela ponderação do rendimento de cada família pela sua dimensão em número de indivíduos. A escala de equivalência do LIS baseia-se na ponderação da renda familiar pela raiz quadrada do número de membros da família.

de informação disponível por meio de curvas de suavização ponto por ponto. Em seguida, modelos multiníveis foram aplicados para estimar as razões de países com menos informações, incluindo no modelo indicadores de década-país, década-região, país, região e se o país é desenvolvido ou em desenvolvimento. As predições foram combinadas para estimar a razão entre as categorias para diversos países, tendo como ***baseline*** de comparação a renda líquida e depois a bruta do LIS.

O terceiro passo da padronização dos dados do SWIID foi feito baseado no suposto que a mudança na distribuição de renda de determinado país é lenta ao longo do tempo. Como a desigualdade contemporânea deve ser similar à desigualdade nos anos precedentes, foi usado um algoritmo que computa uma média móvel ponderada em 5 anos exposta na equação (3.4). As únicas exceções para as quais não foram aplicadas o algoritmo de suavização foram as mudanças dramáticas ocorridas no LIS, que são consistentes ao longo dos eixos temporais e transversais, e as mudanças ocorridas nos países comunistas após o colapso da URSS entre os anos de 1989 e 1992.

$$\mathbf{SWIIDav}_{it} = \left(\frac{1}{6}\right) * (\mathbf{SWIID}_{it-2} + \mathbf{SWIID}_{it-1} + 2(\mathbf{SWIID}_{it}) + \mathbf{SWIID}_{it+1} + \mathbf{SWIID}_{it+2}) \quad \text{(Eq. 3.4)}$$

Finalmente, o quarto e último passo foi a re-estimação dos dados em 100 vezes por meio da aplicação de uma simulação de Monte Carlo e do algoritmo da média móvel em cada simulação. Os valores para todos os dados faltantes depois de 1975 foram interpolados em cada estimação. Como resultado foram gerados duas novas séries de dados padronizados em desigualdade de **renda bruta adulto equivalente da família** e **renda líquida adulto equivalente da família** para mais de 4000 pontos de dados e cobrindo 153 países.

3.2.1.2 Capital Shares

A variável Capital Shares foi compilada por Ortega e Rodriguez (2006), baseando-se nos dados da UNIDO, que desde 1963 coleta informações sobre os agregados industriais para 181 países. Os dados da UNIDO, os mesmos utilizados nas criações do UTIP-UNIDO e no EHII, são coletados por meio de questionários enviados aos governos nacionais. Após o recebimento das informações, os dados são conferidos visando à correção de inconsistências e erros e posteriormente são suplementados com outras fontes nacionais e internacionais de informações econômicas. A verificação é feita visando garantir a comparabilidade internacional e temporal dos dados. Os dados da UNIDO incluem medidas dos **valores adicionados agregados** e **salários** para 136 países permitindo o cálculo do *capital share*, definido como[75]:

$$\textbf{Capshare} = \mathbf{1} - \left(\frac{salarios}{valor\ adicional\ agregado}\right) \qquad \text{(Eq. 3.5)}$$

De acordo com Houle (2009), o conceito de Capital Shares é bastante usado na literatura em política comparada para mensurar a desigualdade[76] por possuir vantagens teóricas e empíricas: a) são consistentes com a literatura que foca o problema da desigualdade entre grupos da sociedade e não a desigualdade total; b) a *capital shares* observa, sobretudo, a

---

[75] Salários são todos os pagamentos feitos aos empregados em um ano e valor adicional é o resultado dos valores dos *outputs* menos os valores dos *inputs* (materiais e insumos para a produção e custos de serviços industriais). Agradecemos a gentileza do professor Christian Houle por ter nos fornecido os dados de *capital share.*

[76] Os autores citados são Dunning (2008), Acemoglu e Robinson (2006) e Przeworski e outros (2000)

desigualdade entre pobres e a elite, ao medir a renda relativa das elites; c) a variável é coletada por uma única fonte – a UNIDO – cuja metodologia é semelhante para todos os países.

Por outro lado, os próprios autores dos dados verificaram empiricamente que esta variável é forte e negativamente relacionada com o nível de desenvolvimento. Ortega e Rodriguez (2006) estimaram que as economias mais desenvolvidas possuem em média 10 pontos percentuais a menos de *capital shares* do que as economias de renda média e 20 pontos percentuais a menos do que países de baixa renda. Tal relação é robusta a diferentes especificações[77]. O mesmo argumento é feito por Ansell e Samuels (2014), que entendem que a variável utilizada por Houle (2009) é mais uma proxy de desenvolvimento do que uma medida de desigualdade, o que explicaria o fato que os achados de Houle sobre a relação entre desigualdade e democratização serem muito semelhantes aos achados de Przeworski e outros (2000) sobre a relação entre desenvolvimento e democratização.

Ademais, um segundo ponto problematizado por Ansell e Samuels (2014) decorre do fato de que a fatia pertencente ao capital em uma dada sociedade pode ser mais ou menos equitativamente distribuída. Isto é, a fração pertencente ao capital em dada economia não nos informa muito sobre como o capital é distribuído entre os agentes econômicos. Caso a fração do produto adicional pertencendo ao capital seja elevada, mas a propriedade do capital ser equitativamente distribuída, a variável não mensuraria adequadamente a desigualdade econômica.

[77] Em nossos dados, a correlação entre Capital Shares e o log de renda per capita é de cerca de -0.4.

Piketty (2014), inclusive, mostra que o período pós-Segunda Guerra Mundial é justamente aquele no qual a propriedade do capital ocupou um peso menor em relação à renda nacional nas economias mais desenvolvidas da América do Norte, Europa Ocidental e Japão. E também demonstra claramente que a 2ª metade do século XX é justamente o período do surgimento de uma classe média patrimonial: uma classe média detentora de capital e que retira sua renda mensal não apenas da renda do trabalho, mas também de renda deste capital.

3.2.2 Dados de desigualdade econômica

Em nossa pesquisa iremos utilizar como fonte de dados principal o banco da **desigualdade de renda bruta domiciliar estimada (EHII)** elaborado pelo Projeto Desigualdade da Universidade do Texas (UTIP). Nessa seção apresentamos algumas estatísticas descritivas de EHII e no capítulo 4 analisaremos os efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade. O banco de dados original inclui 3686 pontos de dados de EHII para 145 países entre 1963 e 2008[78]. Com projeções lineares sempre que havia de um a no máximo oito anos faltantes entre dois pontos de EHII, o banco cresceu para 4138 pontos.

Optamos por priorizar a análise do EHII por dois motivos. É a única proposta metodológica de obtenção de dados que permite a recuperação de pontos do passado, enquanto as metodologias propostas por Solt (2009) – Standardized World Income Inequality Data (SWIID) e Babones e Alvarez-

[78] Quando um país foi dividido ou unificado, a parcela principal do território permaneceu sendo o mesmo país e as outras parcelas tornaram-se novos. Foram divididos Paquistão (Paquistão e Bangladesh) e Etiópia (Etiópia e Eritréia). O país unificado foi a Alemanha. Após a divisão da Tchecoslováquia dois novos países foram criados: República Tcheca e Eslováquia, o mesmo foi feito para a divisão da Iugoslávia.

-Rivadulla (2007) – Standardized Income Inequality Data (SIID) são aplicáveis apenas nos casos onde existem dados de survey de renda. O segundo ponto é que a última versão do UTIP-EHII foi publicada em dezembro de 2013, sendo o mais atual dos bancos de dados sobre desigualdade. Por outro lado, como o SWIID possui uma cobertura tão extensa quanto o do UTIP-EHII e também cobre um vasto período de tempo, 1960 a 2008, também apresentaremos as estatísticas básicas dessa variável[79]. Contando com as interpolações realizadas, temos 4710 pontos de dados no SWIID, sendo que deste total 1967 são ditaduras e 2463 são democracias.

As principais estatísticas descritivas de EHII são apresentadas na Tabela 3 e sua densidade de kernel no Gráfico 3. Em ambas as figuras apresentamos as informações para todo a amostra e também para cada tipo de regime político. Estendemos em todas as análises os valores de GINI e de Capital Shares para um intervalo entre 0 e 100 e não limitado entre 0 e 1. O motivo para tal escolha decorre do fato que um GINI e Capital Shares que variam de 0 a 100 facilitam a interpretação dos coeficientes das regressões quantílica e lineares do próximo capítulo.

No Gráfico 3 apresentamos a distribuição da variável dependente por meio da densidade de kernel. No eixo horizontal está o escopo de valores encontrados na variável dependente e no eixo vertical a concentração de dados em cada intervalo de pontos. A linha sólida indica a distribuição de toda a amostra. Os menores valores são próximos de um GINI de 20 e os maiores de um GINI de 60, mas os dados estão concentrados entre os GINIs de valores de 30 a 50 e a distribuição apresenta uma

[79] Ambos os trabalhos são amplamente citados na literatura: Solt (2009) tem mais de 351 citações no *Google Scholar*, enquanto o trabalho do UTIP-EHII tem cerca de 190 citações. Por sua vez, o banco de dados de Babones e Alvarez-Rivadulla (2007) - Standardized Income Inequality Data (SIID) - também é frequentemente citado, tendo cerca de 180 citações. Dados vistos em: 25 maio 2014.

forma bimodal. O mesmo formato bimodal é encontrado quando vemos a distribuição de EHII apenas para as democracias (linha pontilhada). Ainda que os dados variem entre os valores de 20 e 60, os dois vértices da distribuição estão entre 30 e 40 e entre 40 e 50, sendo o primeiro vértice mais elevado. Já a distribuição de desigualdade econômica em ditaduras (linha tracejada) tem um formato unimodal e o vértice está localizado próximo do GINI de 50. Mas assim como as outras, a distribuição varia entre os GINIs de 20 e 60.
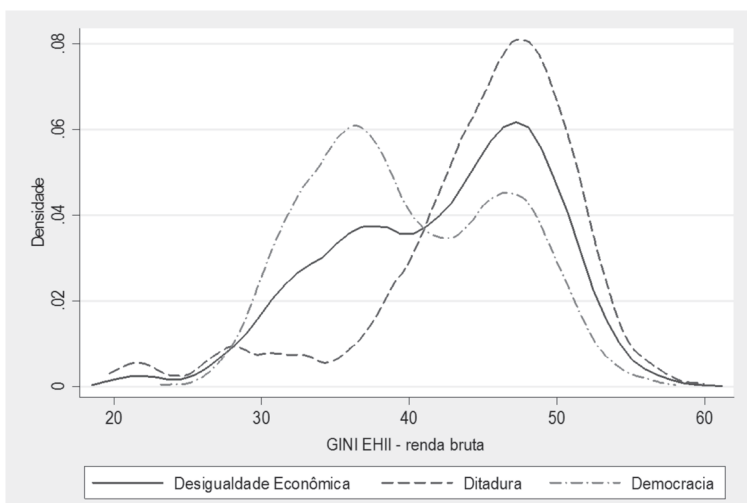
Gráfico 3 – Densidades de Kernel de desigualdade econômica bruta (EHII) por regimes políticos
Fonte: UTIP – EHII e CGV

Ademais, fica claro no Gráfico 3 que o pico da distribuição de desigualdade econômica em democracias é menor que o pico da distribuição em ditaduras, indicado pela diferença na curtose das duas dimensões, embora ambas sejam menos achatadas que a distribuição normal. Os dados descritivos da Tabela

3 mostram ainda que a média e a mediana de desigualdade nas democracias são menores do que nas ditaduras. A proximidade entre os valores médios e medianos de cada curva demonstram que as três distribuições de GINI aproximam-se de uma normal. Por outro lado, curiosamente, mesmo tendo uma média superior à democracia, os primeiros 39 pontos de dados mínimos são todos ditatoriais e referem-se à Alemanha Oriental e Tchecoslováquia. Por sua vez, os desvios padrões e os valores máximos das duas distribuições são semelhantes. Finalmente, as simetrias das curvas são discrepantes, indicando que as duas distribuições estão inclinadas para lados diferentes da média[80].

Tabela 3 – Dados descritivos de EHII_renda bruta

	Toda amostra	**Democracias**	**Ditaduras**
Média	42.26	39.98	44.72
Desvio Padrão	7.11	6.51	6.90
Mediana	43.45	39.01	46.17
Assimetria	-0.46	0.18	-1.34
Curtose	2.60	2.05	5.03
Mínimo	19.70	23.18	19.70
Máximo	59.96	58.03	59.96
Número de Observações	4138	2145	1993

Observação 1: 4 países - anos ditatoriais são mais desiguais que todos os países-anos democráticos: Angola – 1993; Camboja – 1995; Kuwait – 1991 e 1992.

Observação 2: 39 países - anos ditatoriais são mais iguais que todos os países-anos democráticos: Tchecoslováquia – 1963 a 1986 e Alemanha Oriental – 1975 a 1989.

Fonte: UTIP – EHII e CGV

[80] Assimetria ou skewness é a medida do grau em que uma distribuição de probabilidade está inclinada para um lado da média. Uma assimetria negativa indica que a cauda no lado esquerdo da função densidade é maior ou mais ampla do que a do lado direito. Já a curtose é uma medida de dispersão que caracteriza o pico ou "achatamento" da curva. Uma curtose de 0 indica o mesmo achatamento da distribuição normal.

Os achados são um pouco distintos quando observamos os dados de desigualdade econômica bruta pelo SWIID. Os dados estão disponíveis na Tabela 4 e sua densidade de kernel no Gráfico 4. Assim como no gráfico anterior, em ambas as figuras apresentamos as informações para toda a amostra e também divididas de acordo com o regime político. O que fica evidente ao analisamos as distribuições de kernel do Gráfico 4 são que as distribuições de toda a amostra ou dividida por regimes políticos são muito mais semelhantes em praticamente todos os aspectos, variando apenas na curtose de cada curva. Em todas as três distribuições (que seguem o mesmo padrão de formas do Gráfico 3) as curvas são unimodais com o centro da distribuição posicionado de maneira semelhante, os dados variam de GINIs inferiores à 20 à GINIs superiores à 80, embora boa parte da concentração esteja entre os GINIs de 30 e 50.
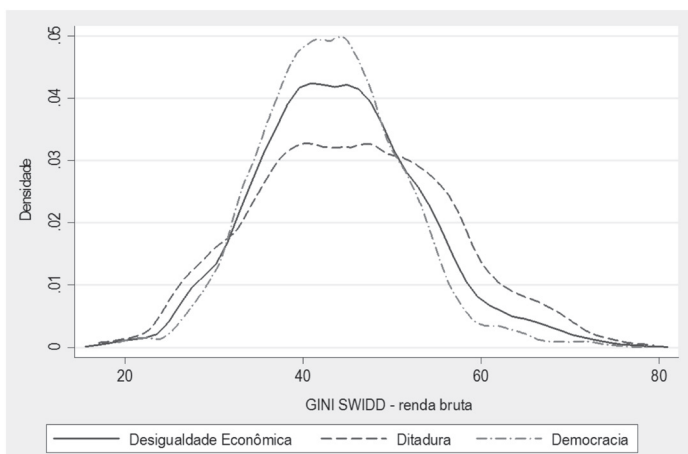
Gráfico 4 – Densidades de Kernel de desigualdade econômica bruta (SWIID) por regimes políticos
Fonte: UTIP – EHII e CGV

Já na Tabela 4 as estatísticas descritivas das três distribuições são essencialmente semelhantes. As médias e medianas

são muito próximas, distando menos de 3 pontos de GINI e os desvios padrões também. O sinal da assimetria também é igual, indicando uma inclinação em relação à média semelhante. A curtose das ditaduras é um pouco menor, o que reflete o fato que o vértice desta distribuição ser mais achatado que os vértices das outras duas curvas, mas as três são mais alongadas que uma distribuição normal. Os mínimos e máximos também convergem.

Em relação aos dados do EHII, as médias e medianas do SWIIDs, com exceção apenas da mediana das ditaduras, são maiores. Por outro lado, as diferenças absolutas entre EHII e SWIID para renda bruta das ditaduras são bem menores (0.85 ponto de média e 0.76 de mediana) do que as diferenças absolutas das democracias (3.15 pontos de média e 3.9 de mediana). Os desvios padrões de cada uma das curvas também são maiores no SWIID, assim como a amplitude total entre os valores mínimos e máximos em média 22.9 pontos de GINI maior nas três curvas de SWIID.

Tabela 4 – Dados descritivos de SWIID_ renda bruta

	Toda amostra	**Democracias**	**Ditaduras**
Média	44.15	43.14	45.57
Desvio Padrão	9.32	7.99	10.90
Mediana	43.65	42.91	45.41
Assimetria	0.34	0.33	0.16
Curtose	3.27	3.68	2.65
Mínimo	17.10	19.25	17.10
Máximo	79.39	78.65	79.39
Número de Observações	4710	2463	1967

Observação 1: 1 país-ano ditatorial é mais desiguais que todos os países-anos democráticos: Maldivas – 1998.

Observação 2: 9 países-anos ditatoriais são mais iguais que todos os países-anos democráticos: Bulgária – 1967 a 1974 e Romênia – 1989.

Fonte: SWIID e CGV

Tabela 5 – Estatística descritiva dos dados de desigualdade

1 – Correlações entre as Medidas de Desigualdade					
	EHII	**SIID_ bruto**	**SWIID_ líquido**	**SWIID_ bruto**	
EHII					
SIID_bruto	0.62				
SWIID_liquido	0.71	0.73			
SWIID_bruto	0.53	0.73	0.86		
Capshare	0.47	0.26	0.41	0.25	
2 – Dados Descritivos					
	N	**Média Geral**	**Desvio Padrão**	**Média Democracias**	**Média Ditaduras**
EHII	4138	42.26	7.11	39.98	44.72
SIID_bruto	2302	42.54	9.16	42.22	42.88
SWIID_liquido	4710	39.05	11.14	36.54	42.55
SWIID_bruto	4710	44.15	9.32	43.14	45.57
Capshare	3427	64.21	12.66	60.86	67.40

Fonte: UTIP-EHII, SIID, SWIID, CAPSHARE e CGV

Na Tabela 5 apresentamos a descrição de todas as outras variáveis de desigualdade, incluindo a mensuração de SWIID para renda líquida, e mostramos como estão fortemente relacionadas com a variável EHII. Como podemos ver nesta tabela, as quatro diferentes mensurações do GINI são bastante correlacionadas, ainda que a relação menor seja justamente entre o SWIID_bruto (GINI para renda bruta) e o EHII. Por outro lado, é interessante observar que a medida do SIID que mensura um índice de GINI para renda bruta tem a mesma correlação com as duas diferentes medidas do SWIID, enquanto o coeficiente de GINI do EHII é mais correlacionado com SWIID_líquido (GINI para renda líquida) do que com o

SWIID_bruto, embora na definição apresentada pela UTIP a medida seja sobre a renda bruta.

Além das variáveis sobre GINI, também introduzimos na Tabela 5 a variável sobre o quanto dos recursos de um determinado país são controlados pelos detentores do capital. A diferença entre a correlação das variáveis é visível. As correlações da variável Capital_Share [**capshare**] com os índices de SWIID_líquido e EHII estão na casa do 0.4 enquanto a correlação com os índices de renda bruta do SWIID_bruto e do SIID_bruto estão próximas de 0.25. Além do mais, a própria média e desvio padrão da variável de Capital_Share é superior aos das outras quatro variáveis de GINI, o que é esperado, uma vez que o conceito mensurado é essencialmente distinto, enquanto as outras possuem estratégias metodológicas diferentes para a computação dos dados, mas tomam como base o mesmo conceito do coeficiente de GINI e o mesmo dado original do WIID.

Observando os dados descritivos da Tabela 5 – que também estão divididos entre ditaduras e democracias, vemos claramente que para todas as variáveis as médias de desigualdade em democracias são menores do que as médias em ditaduras. E as únicas variáveis que tem uma diferença ínfima entre as médias de democracias e ditaduras são os dados de desigualdade bruta do SIID e do SWIID. A diferença entre a desigualdade bruta mensurada pelo EHII é de cerca de 4.5 pontos na escala do GINI, enquanto a diferença entre a desigualdade líquida mensurada pelo SWIID é de 6 pontos. Já em relação ao papel do capital no valor agregado da economia, em ditaduras o capital ocupa uma parcela de 67.4% enquanto em democracias esse valor cai para 60.9%.

3.3 Relação descritiva entre desigualdade e democracia

Nesta seção apresentamos alguns dados descritivos sobre e relação entre as duas principais variáveis da pesquisa. Para regimes políticos usamos os dados de Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010). Sublinhamos, mais uma vez, que assumimos a mensuração dicotômica defendida pelo CGV, que define democracia como um regime no qual existe competição política regulada por eleições. Dividimos nossa amostra em dois grupos distintos de países. O primeiro grupo consiste dos países que não fizeram nenhuma transição política ao longo do período entre 1960 e 2008. O segundo grupo é formado pelos países que fizeram transições democráticas e/ou autoritárias. Obviamente não podemos afirmar que os regimes que não transitaram sejam mais estáveis, uma vez que é possível que tenha havido mudanças de sistema político e de governo sem que a característica democrática ou não democrática do regime tenha sido alterada.
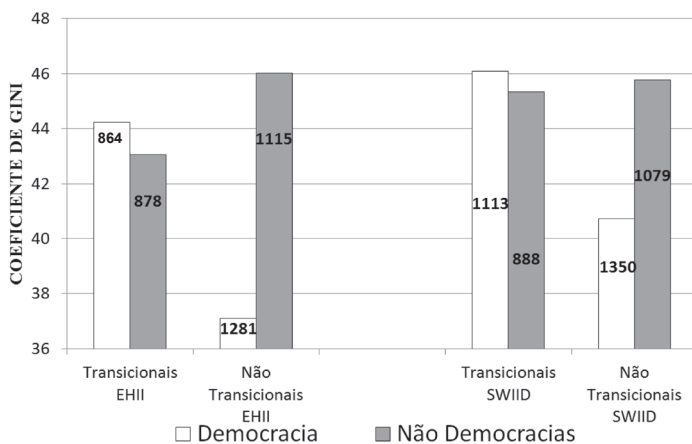
Gráfico 5 – Médias de Desigualdade GINI (EHII_bruto e SWIID_bruto)
Fonte: CGV, UTIP-EHII, SWIID

Optamos por apresentar os dados de acordo com essa divisão, pois há uma importante consequência metodológica da existência de inúmeros casos de países que não atravessam alguma transição política entre a década de 1960 e a primeira década do século XXI: a inadequação do uso de efeitos fixos na estimação em painel. Caso optássemos pelo uso de efeitos fixos na análise empírica, todos estes casos que não apresentam transições (ou variação na variável independente) seriam eliminados da análise: cerca de 48% dos dados do EHII e 44% dos dados do SWIID.

O Gráfico 5 mostra a média de desigualdade em cada um desses dois grupos, tanto no GINI de EHII quanto no GINI do SWIID, sempre dividindo os países-anos em democráticos e não democráticos. No eixo vertical está exposto o valor médio do GINI para cada um dos grupos. No primeiro conjunto de barras temos os dados de EHII e no segundo os de SWIID. Em negrito – no corpo de cada barra – está exposto o número de países-anos de cada grupo. O menor número de países-anos em ambos os conjuntos são das não democracias transicionais (países-anos ditatoriais em países que fizeram alguma transição política), respectivamente 878 (em EHII) e 888 (em SWIID) países-anos; e também das democracias transicionais de EHII: 864 países-anos. Todos os outros grupos possuem mais de 1000 países-anos.

Outra importante constatação que é possível obter a partir da análise das barras do Gráfico 5 é que embora em todas as amostras expostas na Tabela 5 as democracias apresentaram média do GINI inferior ao GINI das ditaduras, podemos ver que isso está nitidamente associado a grande diferença que existe entre os GINIs das ditaduras não transicionais em relação às democracias não transicionais, diferença que se

sobressai ainda mais ao analisarmos os dados de EHII. A diferença no SWIID é de 5 pontos de GINI enquanto a diferença no EHII é de 8.9 pontos. Mas caso optemos por analisar apenas os dados de países que passaram por alguma transição política, as democracias são ligeiramente mais desiguais do que as ditaduras: uma diferença de 1.17 pontos do GINI em EHII e de 0.75 em SWIID. Desta forma, fica evidente que a adoção de uma especificação de um modelo com efeitos fixos gerará um viés importante na análise para encontrar um efeito positivo – do ponto de vista estatístico – da democracia sobre a desigualdade (democracia aumentando desigualdade).

Por outro lado, é importante salientar que as comparações realizadas até aqui ainda são preliminares, não sendo possível elaborar nenhuma inferência causal a partir destes dados. Além de questões metodológicas relacionadas à existência de um potencial problema de causalidade reversa na relação entre democracia e desigualdade, existem inúmeros outros fatores de confusão que afetam esta relação e que precisam ser levados em conta antes de inferirmos a partir de dados observacionais.

Avançando na análise da relação entre as duas variáveis nos Gráficos 6 e 7 (p. 148 e 150), apresentamos a evolução no tempo da média da desigualdade econômica em cada um dos grupos do Gráfico 5 e também para toda a amostra. Observamos a trajetória dos 4 diferentes tipos de regimes – democracias versus ditaduras e a natureza transicional ou não do regime – ao longo do período abrangido pela década de 1970 até à primeira década do século XXI. Visando remediar o problema de dados faltantes, observamos as médias temporais em intervalos

de cinco anos, começando no ano de 1970 até o período quadrienal entre 2005 e 2008. Um ponto importante a ser considerado na análise dos gráficos 6 e 7 é que as tendências dos regimes que tiveram transição são afetadas pela direção da transição política, dificultando a interpretação das movimentações e da evolução no tempo de suas curvas. Já para os dados de regimes que permaneceram iguais, as tendências indicam de fato qual foi a evolução da desigualdade durante estes 38 anos analisados.

No Gráfico 6 apresentamos os dados de desigualdade econômica mensurados pelo EHII. Neste gráfico temos 5 curvas distintas. No eixo horizontal estão dispostos os quinquênios que dividem o período entre 1970 e 2008, no eixo vertical estão os valores médios de GINI para cada um dos grupos. As quatro primeiras curvas referem-se às democracias e ditaduras transicionais ou não e a quinta à evolução da desigualdade em toda a amostra. A curva escura e sem marcador indica que ao longo do período houve um crescimento pequeno da média de desigualdade entre os países em todo o mundo.

O crescimento da média de desigualdade ocorrido nas democracias não transicionais é uma tendência maior e mais estável que nas outras curvas. O que, por sua vez, corrobora a literatura sobre a expansão da desigualdade na América do Norte e Europa. Boa parte da discussão é centrada no debate dos efeitos da expansão das relações de mercado, de relações financeiras menos reguladas e da própria globalização nas economias mais desenvolvidas e o retorno do mundo desenvolvido a uma economia de baixo crescimento, tal como demonstrado em Piketty (2014). As curvas das ditaduras não transicionais também apresentam um forte crescimento da

desigualdade entre 1985 e 1990 e se estabiliza nos anos seguintes. Esse crescimento não pode ser explicado apenas pelos efeitos do fim do mundo comunista, uma vez que nos dados de 1985 só a Alemanha Oriental conta como regime comunista que deixa de existir nos dados do quinquênio que começa em 1990[81]. Mas fica claro que a tendência de crescimento da desigualdade nas ditaduras não transicionais é menor do que nas democracias não transicionais.

EHII - Renda Bruta
50
48
46
44
42
40
38
36
34
1970 1975 1980 1985 1990 1995 2000 2005
DEM NaoTrans — DEM Trans — DIT NaoTrans — DIT Trans — Todos
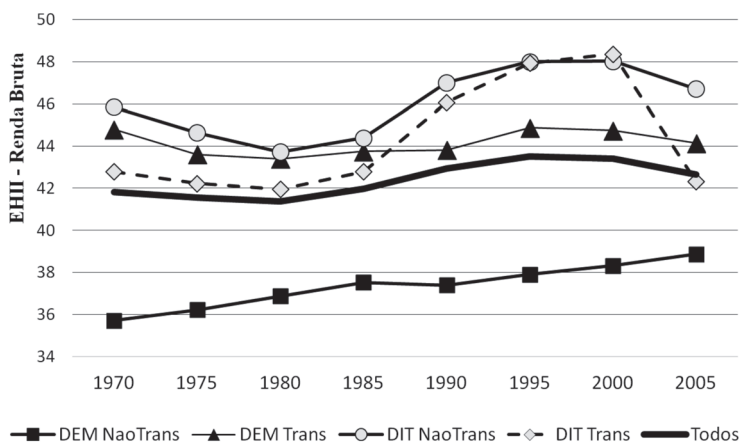
Gráfico 6 – Médias de Desigualdade GINI ao longo dos anos em quinquênios (EHII_bruto)
Fonte: CGV, UTIP-EHII

Por sua vez, as ditaduras transicionais apresentam um pico de desigualdade próximo do quinquênio do ano 2000 e uma profunda queda no momento seguinte, o que é explicado facilmente pelo número de países-anos contidos nos dois

[81] Sem a Alemanha Oriental a média de 1985 cresce apenas de um GINI de 44.40 para um GINI de 45.42

intervalos, que despenca de 24 para apenas 7 casos, todos de apenas 3 países: Nepal, Paquistão e Tailândia[82]. Ademais, o crescimento da desigualdade nas ditaduras transicionais após a década de 1990 é facilmente explicado pela transição dos regimes comunistas no Leste Europeu e Ásia Central. Isto porque com a transição democrática nestes estados, os países ditatoriais mais iguais saem do grupo, aumentando a respectiva média[83]. Por sua vez as democracias transicionais apresentam uma tendência estável, indicando um pequeno crescimento da média de desigualdade apenas na década de 1990.

No Gráfico 7 apresentamos os dados de desigualdade econômica bruta mensurados pelo SWIID. Mais uma vez no eixo horizontal estão dispostos os quinquênios e no eixo vertical está o valor médio de GINI para cada um dos grupos. Mantemos a mesma disposição das 5 curvas e a mesma estrutura de informação. As quatro primeiras referem-se às democracias e ditaduras transicionais ou não e a quinta refere-se à evolução da desigualdade em toda a amostra. No gráfico parece existir uma maior divergência entre os regimes na década de 1970, enquanto nos últimos dois quinquênios as cinco curvas sinalizam uma convergência entre os valores de 41 a 44 pontos de GINI.

Diferentemente do gráfico anterior, todas as curvas desse gráfico indicam que ao longo do período houve uma

[82] Os 24 do caso anterior são de 9 países: Equador, Fiji, Geórgia, Quirguistão, Nepal, Paquistão, Peru, Sudão e Uganda.

[83] No quinquênio de 1990-94 apenas a Albânia, Geórgia, Quirguistão e Sérvia – Montenegro são ditaduras (num total de 6 países-anos com dados), enquanto no quinquênio de 1985-89 temos 21 países-anos com dados de Albânia, Bulgária, Tchecoslováquia, Hungria, Quirguistão, Polônia e România.

diminuição, ainda que pequena, da desigualdade pelo mundo, o que é surpreendente dado o grande consenso a respeito de que desde a década de 1970 assistiríamos a um retorno inexorável da desigualdade econômica, sobretudo nas sociedades mais desenvolvidas, com o avanço da economia de mercado e da globalização econômica.
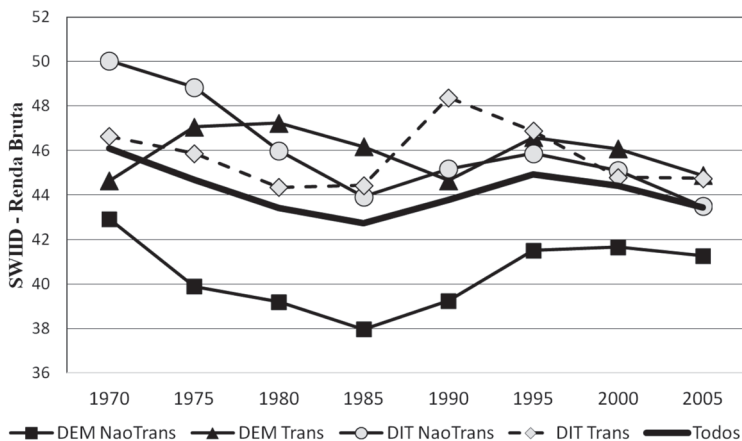
Gráfico 7 – Médias de Desigualdade GINI ao longo dos anos em quinquênios (SWIID_bruto)
Fonte: CGV, SWIID

Por outro lado, a curva das democracias mais consolidadas (que não são as transicionais) tem um formato de U no qual o momento de menor desigualdade foi o quinquênio de 1985, ainda que a desigualdade da década de 1990 seja menor do que a encontrada na década de 1970. Ademais as outras três curvas parecem indicar uma tendência a redução da desigualdade no período indicado, mesmo que os movimentos das três tenham sido marcados por choques e picos, como, por exemplo, o auge da desigualdade em ditaduras transicionais

no quinquênio dos anos 1990 (que é explicado pelo mesmo fenômeno apresentado na nota de rodapé 82).

Mais uma vez, os resultados preliminares indicam que a análise de dados sobre a desigualdade não é um empreendimento fácil. Mesmo partindo de um mesmo conjunto de informações compiladas pela UNU-WIDER, mas com metodologias de padronização dos dados diferentes, os dados indicam tendências da evolução da desigualdade discrepantes. Os padrões apresentados pelos dados de EHII parecem mais próximos dos debates contemporâneos ao apontarem que nas últimas décadas houve aumento da desigualdade econômica nas democracias e ditaduras não transicionais, fruto de hipotéticos efeitos das relações de mercado com a concomitante liberalização do setor financeiro e queda dos regimes comunistas. Por outro lado, não podemos negar o fato que este debate está voltado para as realidades econômicas dos países mais desenvolvidos, que nos gráficos 6 e 7 tendem a estar concentrados na curva de democracias mais consolidadas (não transicionais) e que apresentaram, pelo menos a partir de 1985, crescimento da desigualdade econômica, inclusive nos dados do SWIID. E os movimentos da desigualdade fora dessa região geográfico-econômica tendem a ser menos discutidos pela literatura devido a pouca disponibilidade de dados.

⁂

Como os dados ao longo dos anos são menos informativos para a análise dos efeitos da democracia sobre a desigualdade em países que transitam de um regime político para o outro, propomos uma nova forma de verificar a dinâmica temporal destes. Observamos agora a evolução da desigualdade

econômica segundo o horizonte de democratização, que é definido de acordo com a persistência do regime democrático no tempo. Inaugurado após uma transição, a democracia perdura até atingirmos o ano de 2008 (ano final para o qual temos dados) ou até acontecer uma nova transição que reverta o regime político do país.

Visando facilitar a comparação entre democracia e desigualdade econômica, incluímos também valores negativos no horizonte de democratização. Damos o valor de -1 ao ano imediatamente anterior à transição democrática e assim continuamente, até atingirmos uma transição anterior no tempo ou chegarmos ao ano de entrada do país na amostra (sendo o limite o ano de 1960). É importante salientar que as dinâmicas do lado esquerdo dos gráficos sobre os horizontes de democratização referem-se, portanto, à relação entre desigualdade econômica e o regime anterior à transição e no lado direito a evolução da desigualdade no imediato à transição política e durante o decorrer do regime democrático instaurado.

Assim definimos como 0 (zero) o momento no qual um país se democratiza ou se torna um regime autoritário e como +1 o primeiro ano daquele governo (ou seja, nenhum ano/país recebe o valor de zero nesta mensuração). Os números positivos indicam o avanço no tempo da democracia. Por exemplo, como em nosso banco o Brasil se democratizou em 1985, o ano de 1975 recebe o valor de -10 e o ano de 1994 recebe o valor de +10. Restringimos a análise apenas para os países que fizeram uma transição política. Isto é as democracias e ditaduras transicionais. Optamos por deixar de fora da análise as democracias não transicionais, pois não temos dados sobre desigualdade para o período autoritário anterior a estas transições.

Nos Gráficos 8 a 10 apresentamos essa relação, plotando no eixo vertical os valores médios de EHII e de SWIID e no eixo horizontal os valores do *horizonte de democratização.* No Gráfico 8 mensuramos o horizonte de democratização anualmente, no 9 trienalmente e no 10 por décadas. Optamos por utilizar intervalos de tempo mais amplos para reduzir eventuais problemas causados por dados faltantes. As informações mais importantes são as mais próximas da transição democrática, por três motivos: a) após certo intervalo de tempo, características próprias do regime podem parar de produzir os efeitos sobre a desigualdade se houver retornos decrescentes; b) quanto mais se distancia do momento da transição democrática, menor é o número de anos-países que compõe a média de desigualdade naquele ponto do horizonte de democratização; e c) os efeitos da desigualdade sobre a democracia podem ser observados no imediato anterior à transição política.

Apresentamos os efeitos dos regimes políticos 20 anos antes e 20 anos depois da transição democrática. Para a construção da curva do efeito do horizonte de democratização sobre EHII, temos em média 45 anos-países para os primeiros 5 anos democráticos, 38 para o quinquênio seguinte, 33 para o período entre 10 e 15 anos pós democratização e, por fim, 26 no último quinquênio. Em SWIID os números são, respectivamente, 55, 47, 40 e 32. E nos anos anteriores à democratização temos em EHII 48, 40, 30 e 23 anos-países e para o SWIID temos 49, 37, 24 e 17; todos listados em ordem cronológica inversa e que demonstram claramente a maior confiabilidade dos dados nos arredores da transição política.
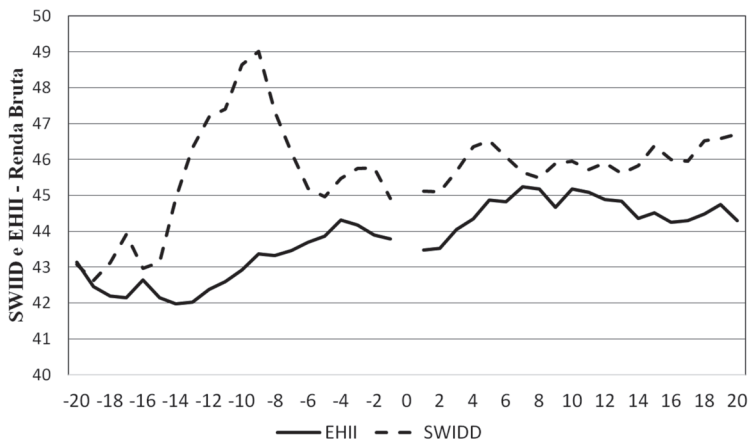
Gráfico 8 – Médias de desigualdade GINI ao longo do horizonte democrático (EHII e SWIID) – anual
Fonte: CGV, UTIP-EHII, SWIID

No Gráfico 8 apresentamos a média de desigualdade econômica entre todos os países que passaram por alguma transição entre 1960 e 2008. O intervalo vazio no meio do gráfico refere-se ao momento da transição e tem a função de deixar devidamente separado o período ditatorial (esquerda) do democrático (direita). A primeira conclusão é que o tipo de regime político não tem efeitos nas duas curvas do EHII e do SWIID. Os dados descritivos demonstram a existência de uma leve tendência de crescimento de desigualdade ao longo do horizonte democrático, mas cuja inclinação independe do regime político ser autoritário ou democrático. O único grande choque encontrado é o pico que existe próximo ao nono ano anterior à transição na curva de SWIID, que é reduzido ao adotarmos intervalos de tempo maiores no eixo do horizonte de democratização.

Fazemos isto no Gráfico 9, no qual apresentamos o mesmo horizonte democrático, mas agora no eixo horizontal estão triênios e não mais anos anteriores e posteriores à transição democrática. Os intervalos de tempo maiores minimizam potenciais distorções causadas por dados faltantes de certos países. O resultado é assaz semelhante ao anterior. Na série dos dados de EHII não há nenhuma mudança estrutural com a alternância de regime. O crescimento visto no momento posterior à transição democrática é o mesmo que já acontecia nos triênios anteriores. Já nos dados de SWIID esse efeito não é aparente, pois há uma importante queda da média da desigualdade entre o quarto e o segundo triênio anterior à democratização, embora no período democrático a tendência seja de um crescimento leve da desigualdade. Contudo, fora este choque, existe uma tendência crescente em toda a série que independe do regime político.
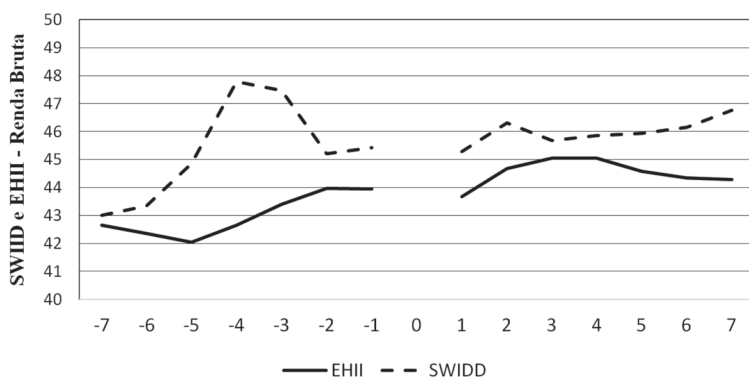
Gráfico 9 – Médias de desigualdade GINI ao longo do horizonte democrático (EHII e SWIID)
Fonte: CGV, UTIP-EHII, SWIID
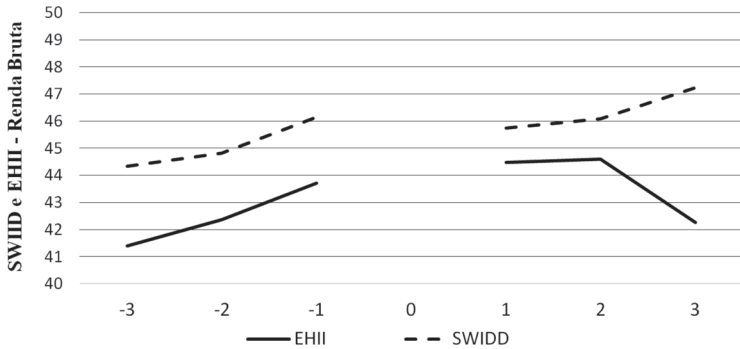
Gráfico 10 – Médias de desigualdade GINI ao longo do horizonte democrático (EHII e SWIID) – por décadas
Fonte: CGV, UTIP-EHII, SWIID

Por fim, no Gráfico 10 apresentamos o mesmo horizonte democrático, tendo como unidade temporal décadas. Os resultados são mais uma vez semelhantes aos anteriores, com exceção apenas do fato de que com os dados de EHII existe uma aparente queda da desigualdade a partir da segunda década democrática, o que pode indicar que os efeitos da democracia sobre a desigualdade não são imediatos, mas sim resultados do acúmulo de práticas da experiência democrática. Tal hipótese foi advogada e testada com razoável sucesso por Muller (1998).

Contudo, na série de SWIID este mesmo padrão não se repete, mas pelo contrário, na terceira década há um aparente crescimento da desigualdade econômica e não arrefecimento do processo, indicando de fato que há uma trajetória de crescimento da desigualdade com o passar dos anos que é completamente independente do regime político em questão.

Podemos concluir, tendo como base os dados apresentados nos gráficos 6 a 10, que a democracia não parece ser um redutor da desigualdade econômica. Os padrões observados

até agora não indicam um efeito distinto da democracia em relação às ditaduras sobre a desigualdade. E a principal diferença encontrada no Gráfico 5 entre democracias e ditaduras não transicionais parece ser mais resultado do fato de que as democracias não transicionais existem em sociedades menos desiguais do que algum efeito específico destes próprios regimes políticos. A análise da dinâmica temporal feita nos 38 anos entre 1970 e 2008, inclusive indica um crescimento efetivo da desigualdade entre as democracias não transicionais. E os dados das democracias transicionais parecem demonstrar por outro lado a inexistência de uma relação entre democracia e desigualdade. Os gráficos 8 a 10 indicam claramente que a transição democrática não afetou o comportamento da desigualdade econômica ao longo do contínuo do horizonte de democratização.

Por outro lado, tal como em toda a literatura apresentada no capítulo 1, estes dados partem de um suposto forte e que deve e será equacionado no próximo capítulo. Ao longo de toda a seção trabalhamos com a ideia de que existe um efeito médio e negativo da democracia sobre a desigualdade. Com o tipo de dado e métodos rudimentares aqui utilizados, não é possível separar os efeitos da democracia em sociedades mais desiguais dos efeitos da democracia em sociedades menos desiguais. Ao longo de todos os gráficos que analisaram conjuntamente as variáveis de regime político e desigualdade econômica, trabalhamos essencialmente com o conceito de média.

Por fim, antes de iniciarmos a análise inferencial da nossa hipótese, desenvolvida no capítulo 4, avançaremos um pouco mais sobre a relação descritiva entre democracia e desigualdade e mostramos na próxima seção qual é o comportamento das duas variáveis numa visão de longo prazo e que abrange os

dois últimos séculos, abrindo espaço para análise de como o processo de democratização das democracias mais antigas, e hoje consideradas como regimes políticos democráticos mais consolidados, afetou a desigualdade econômica.

3.4 Democracia e desigualdade – visão de longo prazo

Nesta seção apresentamos as mesmas estatísticas descritivas da seção anterior a partir de outro banco de dados que contém informações que começam no século XIX (1820) e se estendem até 1992. Uma questão a respeito destes dados é que o esforço de obtenção de uma série mais longa de desigualdade tem como preço uma medida que é menos confiável e que abrange um menor número de países. Contudo, o exercício é válido, pois introduz na análise a democratização dos países desenvolvidos da Europa Ocidental, América do Norte e Oceania, o que não é captado pelos anteriores.

Os dados que permitem esta visão de longo prazo da desigualdade foram elaborados por Ansell e Samuels (2010), a partir de informações organizadas por Bourguignon e Morrisson – BM (2002), cobrindo cerca 53 países em intervalos de 20 anos entre 1820 e 1950 e em intervalos de 10 anos entre 1950 e 1992[84]. Estes autores estimaram a parcela da renda tomada por cada decil da distribuição de renda em cada um dos países com o objetivo de estimar a evolução da desigualdade em todo o mundo durante os dois últimos séculos. A partir destes dados dos decis da distribuição de renda,

[84] Agradecemos a gentileza dos professores Ben Ansell e David Samuels por terem nos fornecido os dados de GINI - BM utilizados em seu trabalho.

Ansell e Samuels calcularam o coeficiente de GINI de cada um destes países em cada um dos intervalos, interpolando linearmente os dados em cada período para ter como unidade básica o país-ano. Segundo os autores, apesar de todos os problemas, os dados do BM são os únicos disponíveis para mensurar a desigualdade antes de 1945 e são amplamente citados na literatura[85].

O primeiro problema decorre do fato que as estimativas são tomadas somente a intervalos de 10 ou 20 anos e Ansell e Samuels organizam os dados por países-anos. Além disto, as estimativas de alguns países são partilhadas com outros que possuem estruturas econômicas semelhantes. Por exemplo, certos pontos de dados da Irlanda são derivados da Grã Bretanha, Portugal e Espanha partilham do mesmo dado, assim como os países escandinavos. De acordo com Bourguignon e Morrisson (2002), o agrupamento foi baseado em considerações de consistência histórica e homogeneidade. Existem de fato apenas 16 estados[86] que estão listados individualmente num total de 33 grupos mensurados. Além desses 16 países, existem mais 17 grupos de mais de um país que são compilados por Bourguignon e Morrisson como fossem uma única estrutura econômica autônoma[87]. Por fim, como terceiro

---

[85] O artigo de Bourguignon e Morrisson (2002) possui 1384 citações no Google Scholar. Acesso em: 16 nov. 2016.

[86] Os 16 países são: Egito, Nigéria, África do Sul, China, Índia, Indonésia, Japão, Brasil, México, Polônia, Rússia, Turquia, França, Alemanha, Itália, Estados Unidos. Todos possuem no mínimo 1% da população mundial.

[87] Os outros 17 grupos são i) Costa do Marfim, Gana e Quênia; ii) África do Norte; iii) outros países africanos; iv) Burma, Bangladesh e Paquistão; v) Tailândia e Filipinas; vi) 45 países asiáticos; vii) Coréia do Sul e Taiwan; viii) Colômbia, Peru e Venezuela; ix) Argentina e Chile; x) 37 países latino americanos; xi) Portugal e Espanha; xii) Bulgária, Grécia, Romênia e Iugoslávia; xiii) Austrália, Canadá e Nova Zelândia; xiv) Áustria, Tchecoslováquia e Hungria;

e último problema a variação geográfica dos dados é menor do que nos outros bancos: 52% dos países-anos pertencem a nações da Europa Ocidental ou do Leste Europeu e ex-URSS, 23% das Américas, 14% da Ásia, 3.5% da Oceania e apenas 8% da África.

Para medir os regimes democráticos, fizemos uma combinação dos indicadores sobre características institucionais e competitivas dos regimes políticos. A primeira é o indicador dicotômico de Boix e Rosato (2001) – BR que classifica, desde 1820, como democráticos os países que possuem: i) legislativo eleito em eleições livres e com vários partidos; ii) executivo eleito direta ou indiretamente pelo voto popular e respondendo diretamente aos eleitores ou à legislatura popularmente eleita; iii) participação (direito ao voto) de no mínimo 50% da população adulta masculina. O trabalho de Boix e Rosato (2001) estendeu o banco CGV para o período anterior à 2ª Guerra Mundial, adotando um critério empírico um pouco menos exigente, mas partindo de uma mesma concepção minimalista e procedimental de democracia (BOIX; ROSATO, 2001; BOIX; MILLER; ROSATO, 2012).

A seguir, incorporamos as informações compiladas por Przeworski (2009), que indicam qual é a extensão legal do direito ao voto em cada país. O banco de dados estendido com informações sobre as instituições e alguns eventos políticos ocorridos desde o estabelecimento das primeiras instituições representativas modernas pode ser visto em Przeworski (2011b). Consideramos como democráticos apenas aqueles

xv) Escandinávia; xvi) Suíça, Beneluz e microestados europeus; e xvii) Reino Unido e Irlanda.

regimes que simultaneamente foram considerados democráticos por Boix e Rosato (2001) e para o quais Przeworski (2009) indica a existência de sufrágio universal legal para todos os homens. Por fim, como critério adicional consideramos autoritários todos os países que permitiam a existência legal da escravidão.

Para o funcionamento adequado da hipótese dos efeitos heterogêneos da democracia é necessário a efetiva realização do sufrágio universal, uma vez que em geral as regras que excluem alguma parte do eleitorado, sejam elas censitárias ou requisitos educacionais, tendem a excluir justamente o segmento menos favorecido da sociedade. O caso brasileiro a respeito da impossibilidade do voto do analfabeto até 1985 é exemplo ilustre desse fato. Posto isto, optamos por incorporar na definição de democracia o requisito do sufrágio universal masculino. Uma melhor identificação de real democracia seria por meio da avaliação do exercício efetivo do direito ao voto. Contudo como não encontramos nenhum autor que tenha mensurado tal elemento, optamos por considerar suficiente o direito legalmente estabelecido do sufrágio universal a todos os homens.

As principais estatísticas descritivas do GINI-BM são apresentadas na Tabela 6 e sua densidade de kernel no Gráfico 11. Em ambas as figuras apresentamos as informações para toda a amostra e também para cada regime político. Mais uma vez estendemos os valores do GINI para um intervalo entre 0 e 100 pelas mesmas razões apresentadas anteriormente.

Na Tabela 6, as democracias mais uma vez possuem uma média e mediana de desigualdade econômica inferior às das ditaduras. Outra constatação é que o número de anos-países ditatoriais é duas vezes superior ao número de anos-países

democráticos, o que é esperado, uma vez que a primeira experiência democrática só ocorre em 1850 e só a partir de 1864 existem países que permanecem como democracia por longos períodos de tempo. E as curvas de distribuição também são um pouco diferentes em relação à curtose e à assimetria, o que fica bem claro no Gráfico 11 onde apresentamos as densidades de kernel da desigualdade econômica em toda a amostra e para as democracias e ditaduras separadamente. Comparando com os dois gráficos de densidades apresentados anteriormente, fica patente como os dados do BM mostram um comportamento mais discrepante entre as curvas de desigualdade em democracias e em ditaduras.

Tabela 6 – Dados descritivos de GINI - BM

	Toda amostra	Democracias	Ditaduras
Média	45.02	41.73	46.67
Desvio Padrão	6.48	5.97	6.09
Mediana	44.94	40.60	46.67
Assimetria	-0.28	0.34	-0.65
Curtose	2.97	3.00	4.05
Mínimo	27.66	27.66	27.66
Máximo	62.04	55.72	62.04
Número de Observações	5718	1905	3813

Observação 1: 83 países-anos ditatoriais são mais desiguais que todos os países-anos democráticos: todos pertencentes à África do Sul de 1910 a 1992.

Fonte: BM-GINI

Nestes novos dados que possibilitam uma visão de longo prazo da desigualdade, há uma concentração maior da distribuição de GINI para democracias à esquerda, enquanto para as ditaduras a concentração está mais à direita. A distribuição de BM em ditaduras tem um formato trimodal com os três

vértices localizados entre os GINIs de 45 e 55. Já a distribuição de BM em democracias é unimodal com um único vértice em torno de 40. Por outro lado, são bastante semelhantes os desvios padrões das duas distribuições, assim como os mínimos, máximos e a própria amplitude total.
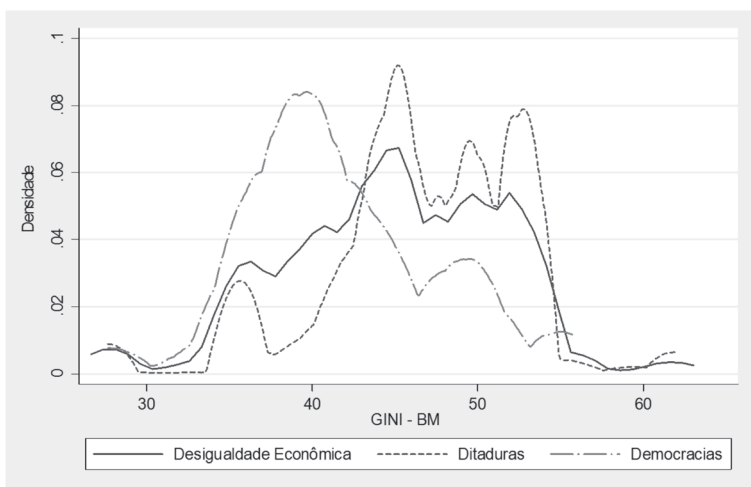
Gráfico 11 – Densidades de Kernel de desigualdade econômica de longo prazo (BM) por regimes politicos
Fonte: BM-GINI

No Gráfico 12 (p. 166) apresentamos a evolução da média de desigualdade ao longo do tempo – desde 1820 até 1992 – para toda a amostra, para as ditaduras e para as democracias. Obviamente o número de pontos de dados é bem menor nos primeiros anos da amostra. De 1820 a 1849 são apenas 17 casos, entre 1850 e 1870 são 26 casos, 40 casos a partir de 1930 até o máximo de 49 casos em 1992. Há um primeiro episódio democrático apenas em 1848-49 e 1851 na França, mas de fato a primeira democracia surge apenas em 1864 (Grécia), a

segunda em 1865 (EUA), a terceira em 1870 (Nova Zelândia), a França novamente em 1870 e assim por diante. Somente em 1910 temos mais de 10 democracias e só depois de 1950 mais de 20. Visando maximizar a informação contida nos dados, o Gráfico 12 tem como unidade de análise a média de desigualdade por décadas desde 1820 até 1990 e por tipo de regime político. No eixo vertical, como nos outros gráficos, estão os valores médios de GINI e no eixo horizontal as décadas.

O Gráfico 12 apresenta um padrão bem interessante. Enquanto no século XIX não há diferenças gritantes entre a média da desigualdade nas democracias e nas ditaduras, após a 1ª Guerra Mundial há um forte aumento na distância entre as duas curvas, que se mantém bastante parecido até o final da década de 1950 (mesmo que durante esse período ambas apresentem uma tendência declinante bastante relevante). A diferença entre as duas médias na primeira década do século XX é de apenas 1.1 pontos de GINI, enquanto que em 1950 essa diferença sobe para 4.6 pontos. Esse diferencial é um pouco reduzido entre as décadas de 1960 e 1970, e em 1980 a diferença é de apenas 3.2 pontos de GINI. E apenas no último ponto de dado, a média do triênio 1990-1992, a divergência entre democracias e ditadura cresce abruptamente para 8.5 pontos de GINI.

Este período entre 1900 e 1950 também é analisado por Thomas Pikkety (2014) como um momento no qual há uma enorme queda da desigualdade nas economias mais desenvolvidas da Europa. Para o economista, as principais causas subjacentes a este forte processo redutor da desigualdade foram os esforços de mobilização nacional nas duas Grandes Guerras, que tiveram entre suas consequências a destruição parcial do estoque de capital das elites econômicas por meio do próprio

conflito ou como fonte de financiamento do estado, a prolongada crise da Grande Depressão, a perda do valor dos títulos da dívida pública com o surgimento de economias inflacionárias e o próprio processo de descolonização da África e Ásia, com o qual parte dos ativos estrangeiros europeus evaporaram.

Por fim, repetindo a análise feita na seção anterior, apresentamos no Gráfico 13 a evolução da desigualdade econômica segundo o horizonte de democratização. Definimos horizonte de democratização da mesma forma: a persistência do regime no tempo. Inaugurado após uma transição democrática e perdurando até atingirmos o ano de 1992 ou até acontecer uma nova transição que reverta o regime político do país. O 0 (zero) determina o momento no qual um país se democratiza e como +1 o primeiro ano terminado naquele governo (ou seja, nenhum ano-país recebe o valor de zero nesta mensuração). Os números positivos indicam sempre o avanço no tempo da democracia, enquanto os números negativos referem-se ao período autoritário anterior a uma transição democrática. O gráfico apresenta a média da desigualdade nos regimes autoritários nos 30 anos anteriores à democratização (esquerda do gráfico) e nos trinta anos democráticos posteriores (direita)[88].

[88] Visando facilitar a comparação entre democracia e desigualdade econômica, incluímos também valores negativos no horizonte de democracia. Damos o valor de -1 ao ano imediatamente anterior à transição democrática e assim continuamente, até atingirmos uma transição anterior no tempo ou chegarmos ao ano de entrada do país na amostra. As dinâmicas do lado esquerdo dos gráficos sobre os horizontes de democracia se referem, portanto, à relação entre desigualdade econômica e o regime anterior à transição e no lado direito a evolução da desigualdade no imediato à transição política e durante o regime democrático instaurado.
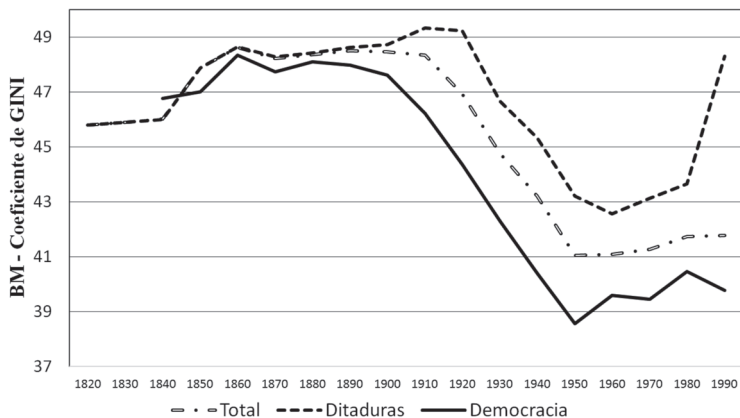
Gráfico 12 – Médias de desigualdade GINI (BM)
por décadas e por regime político
Fonte: BOIX-ROSATO e BM-GINI

O Gráfico 13 demonstra um padrão extremamente interessante de evolução da desigualdade segundo o horizonte de democratização. Entre os trigésimo e vigésimo anos autoritários anteriores à democratização (assinalada pelo ano 0), não há alteração no nível de desigualdade econômica. Já nos dez últimos anos do regime autoritário, há o início de um processo de redução da desigualdade que se estende até o vigésimo ano pós-democratização, mesmo que nos primeiros anos após a transição democrática exista um pico de aumento da desigualdade que depois é rapidamente revertido. Isto é, a própria transição democrática não parece afetar a média da desigualdade e nem a sua tendência de evolução. A principal constatação é que já no período anterior à transição, os países entram em um processo de redução da desigualdade que se estende no posterior da transição política e durante a própria

consolidação da democracia, se estabilizando somente a partir do vigésimo ano democrático[89].

Gráfico 13 – Médias de desigualdade GINI (BM) ao longo do horizonte democrático – visão de longo prazo
Fonte: BOIX-ROSATO e BM-GINI

Interessante apontar que esta possível interpretação dos dados expostos no Gráfico 13 contraria à tese de Ansell e Samuels (2010 e 2014). O argumento defendido por Ansell e Samuels parte da teorização de que a democratização decorre do surgimento de uma elite econômica e mesmo de uma classe média autônoma do Estado, que demandam proteção contra o poder expropriativo do Leviatã absolutista. Isto implicaria, do ponto de vista empírico, que há uma associação entre o crescimento da desigualdade e um concomitante aumento da probabilidade de democratização. E isto não é o que parece ocor-

[89] Consolidação entendida simplesmente como a persistência no tempo do regime democrático.

rer nos dados do Gráfico 13 nos anos anteriores à transição democrática. A tendência apresentada no imediato anterior à transição democrática é nitidamente crescente e persiste após a mudança de regime político.

Obviamente não temos a pretensão de resolver este impasse teórico com uma análise puramente descritiva. Conforme já exposto ao longo do texto existe uma miríade de fatores de confusão que permeiam a relação entre democracia e desigualdade. Contudo, é interessante notar como a relação de longo prazo entre desigualdade e democracia parece tomar uma perspectiva bastante distinta daquela encontrada no período entre 1960 e 2010. Desta forma, após testarmos a hipótese sobre a heterogeneidade dos efeitos da democracia sobre a desigualdade nos dados mais refinados e confiáveis da 2ª metade do século XX, verificaremos se esta hipótese encontra respaldo empírico em uma visão de maior longo prazo, ainda que mais restrita geograficamente.

3.5 Variáveis de controle

Como apresentamos no último parágrafo, a relação entre democracia e desigualdade é permeada por outros fatores que a afetam simultaneamente. Desta maneira, não podemos realizar nenhuma afirmação conclusiva a respeito de algum tipo de relação causal entre as duas variáveis com os dados descritivos expostos ao longo desse Capítulo 3, sem que esses possíveis fatores de confusão sejam controlados. Variáveis e fatores como o grau liberalização dos mercados, a globalização, o capital humano e também o nível de desenvolvimento

de cada país podem desempenhar um papel relevante e tornar espúrias algumas das relações encontradas.

Tomando como ponto de partida as contribuições da literatura recente, iremos controlar a análise para quatro conjuntos de variáveis, que mensuram: os processos de liberalização e expansão das relações de mercado i) no nível do país e ii) em nível global; iii) o nível de desenvolvimento econômico de cada país e, por fim, iv) o nível educacional da população como proxy do capital humano e da distribuição das habilidades presente no sistema econômico daquela sociedade.

Conforme já exposto anteriormente, é de fundamental importância controlar para os fatores de mercado uma vez que democracia e mercados tendem a andar juntos no mundo contemporâneo. Ainda mais depois do fim da guerra fria e da terceira onda de democratização, quando vigora um processo distinto, mas concomitante da expansão de regimes políticos democráticos e disseminação de processos econômicos liberalizantes em temas de comércio exterior e das próprias relações econômicas nacionais.

Como esses dois processos ocorrem ao mesmo tempo é bastante provável que os reais efeitos da democracia sobre a desigualdade sejam mitigados pelos efeitos causados por relações econômicas menos reguladas. Do mero fato que um país se democratiza e apresenta dados crescentes de desigualdade não decorre que a democracia não seja uma força equalizadora da sociedade, é possível que a democracia esteja reduzindo a velocidade do aumento da desigualdade que o processo de expansão das relações de mercado impõe.

Os processos de democratização política e liberalização econômica, embora concomitantes, são independentes.

A história chilena ilustra bem esse fato. Antes do golpe comandado pelo general Augusto Pinochet, o então presidente Salvador Allende, que havia sido eleito democraticamente, estava direcionando a política econômica chilena para um ponto distante dos mercados. E depois de 1973, o regime militar de Pinochet colocou o Chile no caminho da liberalização econômica em um momento em que não havia mais liberdade política. Posto de outra forma, a liberdade política não é equivalente à liberdade de comprar (GALBRAITH, 2008).

Desta forma, iremos controlar nossa análise para quatro variáveis que buscam capitar os processos de mercado:

a) Processos de Mercado dentro do país

i. Abertura Econômica: Volume total de comércio (exportação e importação) como percentagem do PIB a preços constantes. Dados da Penn World Tables versão 7.1 (HESTON; SUMMERS; ATEN, 2012*).*

ii. Participação do Governo: Proporção dos gastos do governo em relação ao PIB a preços constantes. Dados da Penn World Tables version 7.1 (HESTON; SUMMERS; ATEN, 2012*).*

b) Globalização: processos de Mercado em escala global

iii. Comércio Mundial: Log (Soma de todas as correntes de importação e exportação em cada ano / 2). Dados da Penn World Tables version 7.1 (HESTON; SUMMERS; ATEN, 2012*).*

iv. Variável Binária como indicador do Período Pós Guerra Fria: 1 - depois de 1990; 0 - caso contrário.

Também vamos controlar nossa análise para o nível de desenvolvimento de cada país, pois é amplamente reconhecido que o nível de desenvolvimento está altamente correlacionado com a democracia e também com a própria desigualdade, tal como proposto pela famosa curva de Kuznets (1955). Além disso, não podemos desconsiderar o fato de que os países desenvolvidos têm mais recursos para lidar com problemas decorrentes da desigualdade, uma vez que a questão da sobrevivência econômica e reprodução social das elites, classes médias e mesmo dos segmentos mais empobrecidos são conquistas já garantidas. Mensuraremos o nível de desenvolvimento de cada país por meio de suas variáveis: o PIB real per capita e o índice de urbanização.

v. Desenvolvimento: Log do PIB Real per capita em formato quadrático. Dados da Penn World Tables version 7.1 (Heston, Summers and Aten 2012).

vi. Urbanização: Porcentagem urbana da população total. Dados do Banco Mundial 2013. (WORLD BANK GROUP WDI, 2013).

Por fim, a disponibilidade de capital humano também pode afetar a relação entre democracia e desigualdade. Isto porque quanto mais bem educada e dotada de habilidades, mais recursos os indivíduos da sociedade possuem para superar os desafios econômicos impostos pela integração dos mercados e globalização, ao passo que também existe uma associação entre o nível educacional e o regime político: quanto mais qualificado é o *demos* de determinada sociedade, maior é sua capacidade de exigência de controle e responsividade das ações do governo.

Desta forma, incluímos na especificação uma variável que mensura o nível de escolaridade médio da população.

vii.Escolarização: **Escolaridade média da população adulta masculina com mais de 25 anos**. *Dados do Institute for Health Metrics and Evaluation (IHME) – University of Washington.* (GAKIDOU et al., 2010; HOGAN et al., 2010; RAJARATNAM et al., 2010).

Na Tabela 7 abaixo apresentamos a estatística descritiva das variáveis de controle e a fonte de informação de onde obtivemos os dados. Com exceção da variável de globalização que é um indicador do período pós 1990 e da variável escolarização, todas as outras foram obtidas a partir das informações compiladas pelo Penn World Tables versão 7.1 (HESTON; SUMMERS; ATEN, 2012) e pelo Banco Mundial em sua série de indicadores (WORLD DEVELOPMENT INDICATORS - THE WORLD BANK, 2013). Por fim, os dados de educação foram elaborados *pelo Institute for Health Metrics and Evaluation* da Universidade de Washington (GAKIDOU et al., 2010; HOGAN et al., 2010; RAJARATNAM et al., 2010).

No próximo capítulo discutiremos a relação entre democracia e desigualdade em seus pormenores, incorporando os dados aqui apresentados à discussão teórica e metodológica sobre os efeitos heterogêneos da democracia ao longo dos diferentes pontos da distribuição de desigualdade econômica entre os países realizada no Capítulo 2.

Tabela 7 – Estatística descritiva das principais variáveis de controle[90]

Variáveis	Indicador	N	Média	Mediana	Des. Pad	Fonte
Abertura Econômica	$\frac{imp_{it} + exp_{it}}{PIB\ real_{it}}$	6638	69.00	57.43	49.79	PWT
Participação do Governo	$\frac{gastopublico_{it}}{PIB\ real_{it}}$	6638	18.69	15.87	10.75	PWT
Comércio Mundial	Ln $\{\sum_1^j (\frac{imp_j + exp_j}{2})\}$	7980	26.49	26.64	1.00	PWT
Globalização	1: *pós* 1990 *e* 0: *não*	7980	0.31	0.00	0.46	próprio
Desenvolvimento	Ln {PIB real *per capita*$_{it}$}	6638	1.10	8.43	1.10	PWT
Urbanização	$\frac{pop\ urbana_{it}}{pop\ total_{it}}$	8269	47.82	46.05	24.51	WDI
Escolarização	Anos de educação médio para adultos	6928	6.07	5.7	3.28	IHME

[90] Os dados foram originalmente organizados por Heston, Summers e Aten (2012), Rajaratnam et al. 2010; Hogan et al. 2010 e pelo Banco Mundial (2013), mas utilizamos a compilação heroica de dados realizada pelo *The Quality of Government Institute* em maio de 2013, que organizou um único arquivo diversos banco de dados que tem a estrutura de países-ano como unidade de análise (TEORELL et al., 2013). Disponível em:<http://www.qog.pol.gu.se>.

Análise inferencial

4.1 Identificação de democracia

O objetivo deste capítulo é destrinchar empiricamente a relação entre democracia e desigualdade conforme os problemas teóricos e questões metodológicas apresentados nos capítulos anteriores. Em primeiro lugar, temos como objetivo teórico-empírico principal discutir a questão se a democracia seria ou não uma ferramenta de redução da desigualdade econômica. Conforme já exposto anteriormente, tomamos como ponto de partida uma definição minimalista de democracia, compreendida apenas como uma forma competitiva de escolha por parte dos cidadãos das principais lideranças políticas. E, dada esta natureza competitiva da democracia, propusemos no capítulo 2 a hipótese de que a desigualdade tornar-se-ia um *assunto relevante* na competição eleitoral apenas nas sociedades mais desiguais: exatamente nas quais a desigualdade econômica estimula o surgimento de uma demanda por distribuição por parte da cidadania e também um interesse dos partidos que competem pelo poder político em ofertar políticas redistributivas, criando na sociedade a ideia de que a desigualdade seria resultado de injustiça e desequilíbrio social.

Para responder a esta questão, utilizamos como método mais adequado para a estimação dos efeitos heterogêneos

da democracia sobre a desigualdade o *framework* de regressão quantílica, que permite a estimação dos efeitos da democracia ao longo de diferentes pontos da distribuição de desigualdade econômica entre os países. Para isto estimamos inúmeras regressões para verificar o efeito da democracia em diferentes pontos da distribuição de desigualdade econômica.

Um primeiro desafio metodológico a ser superado é a possível **causalidade reversa** entre democracia e desigualdade. Na literatura sobre os processos de democratização, a existência de desigualdade econômica dentro de determinada comunidade política dificulta as chances de sucesso do projeto democrático (BOIX, 2003; ACEMOGLU; ROBINSON, 2006; HOULE, 2009) ou na revisão proposta por Ansell e Samuels (2014), o surgimento de uma elite econômica independente tem impacto positivo no índice de GINI e ao mesmo tempo aumenta a probabilidade de democratização de um país.

Para resolver este problema, utilizamos o método de estimação por variável instrumental. Conforme exposto no capítulo 2, adotamos três diferentes conjuntos de instrumentos para estimar o verdadeiro efeito da democracia sobre a desigualdade. O primeiro é composto de um conjunto de variáveis relacionadas aos processos de difusão de democracia. E o segundo é um instrumento relacionado à *herança colonial britânica*. Ambos os conjuntos não possuem uma natureza completamente exógena ao mundo da política. Já o terceiro conjunto é composto por variáveis que captam o posicionamento longitudinal de um país no planisfério. As duas variáveis utilizadas para captar esse fenômeno são por definição estritamente exógena à relação entre democracia e desigualdade, uma vez que o posicionamento longitudinal de um país é um dado independente de sua conformação política e social

e também não existem estudos ou teorias, até onde pudemos verificar, que relacionem a longitude de um país com a sua desigualdade econômica.

Quadro 2 – Instrumentos de democracia

1) Instrumentos de Difusão:
a) Difusão mundial de democracia: número de democracia existentes no ano / número de países existentes no ano. [**difmundo**]
b) Difusão continental de democracia: número de democracia existentes no continente no ano / número de países existentes no continente no ano. [**difcont**]
c) Difusão subcontinental de democracia: número de democracia existentes no subcontinente no ano / número de países existentes no subcontinente no ano. [**difregião]**
d) Difusão ponderada de democracia: média simples das medidas (a); (b) e (c) [**difpond1**]
e) Difusão ponderada de democracia dado a relevância regional e continental do país: média de (a), (b) e (c), ponderada pelo peso territorial do país no continente e no subcontinente, respectivamente [**difpond2**]
2) Herança Britânica: indicador se o país possui herança britânica, incluindo o próprio Reino Unido e ex-colônias americanas e australianas, adaptado de (HADENIUS; TEORELL, 2005) [**british]**
3) Localização Longitudinal **a) Hemisférico Oriental:** indicador se o país possui localização longitudinal ao oriente do meridiano 36º (Turquia). [**horiental**] **b) Longitude:** log da longitude de um país calculado por 105+longitude. **[llong]**

A intuição básica subjacente à abordagem instrumental é estimar o efeito da variável endógena (a independente com problema de causalidade reversa) democracia, usando uma variável exógena correlacionada apenas com a variável endógena e não com a variável dependente – desigualdade econômica, isolando, assim, os efeitos da primeira sobre a última. A validade da estimação por variável instrumental depende

crucialmente da seleção de um instrumento adequado, que satisfaça os dois critérios: (a) ser correlacionado com a variável endógena; e (b) não possuir um efeito causal na variável dependente (ou, por extensão, no termo de erro da equação estimada). O atendimento a estes critérios implica que qualquer alteração na variável dependente que resulte de mudanças nos valores de um instrumento deve ser atribuída à variável endógena e, deste modo, livre da relação recíproca entre a variável dependente e a variável endógena (SAVUN; TIRONE, 2011). No Quadro 2 reapresentamos o Quadro 1 onde listamos os potenciais instrumentos selecionados.

Nas tabelas 8, 9 e 10 (p. 183, 185 e 188) apresentamos os coeficientes, erros padrões e os Testes F do 1º passo de cada uma das regressões utilizando defasagens dos instrumentos de difusão e dos indicadores de herança britânica e de longitude[91], de modo a apresentar quais são os instrumentos adequados para a análise inferencial da relação entre democracia e desigualdade. Na última linha apresentamos os testes F conjunto de todos os instrumentos presentes no modelo. Na Tabela 8 adotamos uma especificação com efeitos fixos continentais[92], na Tabela 9 incluímos

---

[91] Foram incluídas nas regressões as variáveis controles presentes no modelo final, além do indicador de democracia do CGV (demo). Essas variáveis foram detalhadas na Tabela 7: Abertura Econômica; Participação do Governo; Comércio Mundial; Globalização, Desenvolvimento (em formato quadrático); Urbanização; Escolarização. Além destas incluímos uma variável de tendência em forma quadrática e efeitos fixos continentais. Não apresentamos os efeitos das variáveis controles, pois no momento estamos interessados em verificar apenas se os instrumentos identificam a relação entre democracia e desigualdade. Obviamente a amostra do 1º passo é limitada aos casos para os quais possuímos informações sobre desigualdade econômica mensurada pelo UTIP-EHII.

[92] Os continentes são América; Europa e ex-URSS; África e Oriente Médio; Ásia; e Oceania.

efeitos fixos continentais e temporais e, por fim, na Tabela 10 incluímos efeitos fixos regionais e temporais[93].

A disposição das variáveis nas três tabelas é a mesma. Na coluna (1) apresentamos os efeitos dos instrumentos quando entram no 1º passo como única variável de identificação. Para tal foram rodadas regressões para cada um dos potenciais instrumentos. Na coluna (2) inserimos as mensurações puras de difusão regional, continental e mundial conjuntamente. Na coluna (3) analisamos conjuntamente os indicadores hemisféricos e de herança britânica, além da localização contínua da longitude do país. Observando os resultados das três primeiras colunas, incluímos na coluna (4) apenas os instrumentos adequados para a análise empírica. Diante dos resultados deste modelo, apresentamos na coluna (5) os instrumentos que identificam fortemente democracia e que, portanto, são mantidos nas análises daquela especificação[94].

A análise cuidadosa do 1º passo é fundamental, pois conforme já demonstrado na literatura econométrica, quando os instrumentos estão fracamente correlacionados com os regressores endógenos – não atendem ao critério (a) para a validade do instrumento – os resultados convencionais assintóticos falham, mesmo na presença de amostras grandes (STAIGER; STOCK, 1997).

Como apontado por Bound, Jaeger e Baker a "cura" para a existência de causalidade reversa na relação de interesse pode

---

[93] As regiões são América do Norte e Central; Am. do Sul; Europa Ocidental; Leste Europeu e ex-URSS; África do Norte e Oriente Médio; África Subsaariana; Extremo Oriente; Ásia do Sul; Sudeste Asiático; e Oceania.

[94] Como as variáveis de democracia e difusão estão com defasagens, perdemos 30 países-anos nos modelos que incluem alguma variável de difusão. Assim, o N dos modelos sem difusão é 3811 e o N dos modelos com difusão é sempre 3781. Na estimação da relação heterogênea entre democracia e desigualdade, democracia está defasada em um e difusão de democracia em dois anos.

ser "pior que a doença" na presença de instrumentos fracos. Posto isto, nos próximos parágrafos analisamos os resultados do 1º estágio em seus pormenores, observando as diversas formas nas quais podemos usar o conjunto de 08 instrumentos apresentados no Quadro 2 e quais podem de fato identificar democracia, atendendo aos dois critérios exigidos pelo método (BOUND; JAEGER; BAKER, 1995).

Na coluna (1) da Tabela 8 observamos que nem todas as cinco mensurações de difusão configuram como instrumentos fortes de democracia. As variáveis de difusão na região **difregião** e difusão ponderada **difpond1** são significantes à 95% de confiança, enquanto difusão no mundo **difmundo** e difusão ponderada pela relevância territorial **difpond2** são significantes apenas à 90%. Por sua vez, difusão continental **difcont** não tem relação significante com democracia. A única variável de difusão com teste F superior à 10 é **difregião**[95]. Além do mais, um resultado muito interessante obtido na coluna (1) é o fato de que difusão mundial de democracia **difmundo** está negativa e significantemente relacionada com democracia. E os outros três instrumentos, o conjunto sobre a posição longitudinal **llong** e **horiental** e o indicador de herança colonial britânica **british**, nenhum é significante à 90% e todos têm um teste F inferior à 2.70.

Na coluna (2) testamos em conjunto apenas as mensurações puras de difusão regional, continental e mundial da democracia. A primeira constatação é que, neste modelo, as variáveis agregadas em circunscrições geográficas mais elevadas

[95] Staiger e Stock propõem como regra de bolso que em modelos que incluam apenas uma única variável endógena, os instrumentos são fracos se o Teste-F do 1º estágio for menor do que 10 (STAIGER; STOCK, 1997).

(continental e mundial) são negativa e significantemente associadas com democracia, enquanto apenas a variável difusão regional **difregiao** tem relação positiva com democracia a 99% de confiança. Além do mais, todos os três testes Fs melhoram, sendo que o teste da última variável atinge 16.02. Interessante observar ainda que o teste F do modelo completo com as três variáveis de difusão de democracia (F = 5.80) é maior e mais significante do que o teste F do modelo que utiliza as variáveis resumo que ponderam a difusão nos três níveis geográficos, respectivamente F = 5.43 para **difpond1** e F = 3.51 para **difpond2**[96]**.**

Em consequência destes resultados, optamos como método de identificação da democracia a utilização das três variáveis puras de difusão **difmundo**, **difcont** e **difregião** e não as variáveis ponderadas. Além de termos um instrumento com teste F superior a 10, tal como defendido por Staiger e Stock (1997), a sumarização destas três medidas de difusão em **difpond1** e **difpond2** tem menor poder de identificação do que a utilização conjunta das três variáveis. Além disso, outra justificativa desta escolha é a incapacidade de as variáveis ponderadas captarem os distintos efeitos da difusão de democracia em diferentes circunscrições geográficas, um resultado inesperado, mas consistente ao longo de todo este estudo, não importando as especificações apresentadas[97].

---

[96] O R^2 do modelo com as variáveis puras é maior também que os R^2 dos modelos com as variáveis ponderadas **difpond1** e **difpond2.** Os valores são, respectivamente, 0.5035; 0.4860; e 0.4828.

[97] Interessante observar a movimentação dos sinais dos coeficientes de cada uma das variáveis de difusão. Indo em direção contrária às teorias sobre a difusão da democracia, encontramos um efeito negativo da expansão da democracia no mundo **difmundo** e no continente **difcont** sobre as chances de um país ser uma democracia nas colunas (1) e (2). Já a variável difusão de democracia na região **difregião** tem o sinal esperado em ambas colunas. Uma possível explicação

Na coluna 3 incluímos as outras três variáveis instrumentais restantes em um único modelo. As duas variáveis longitudinais, o indicador hemisférico **horiental** e a **longitude llong** são significantes, a primeira a 90% e a segunda a 95%. Contudo, curiosamente, seus sinais são invertidos. Enquanto ambas crescem no sentido do oriente, o indicador hemisférico dá indícios que o hemisfério ocidental é mais democrático que o oriental, mas a variável longitudinal indica que, controlado o efeito hemisférico, quanto mais no oriente um país está, mais democrático ele é. Este resultado permanece em todas as especificações testadas.

Já a variável "herança colonial britânica" não está associada com democracia, o que também é outro achado na contramão das expectativas. E mesmo se expandirmos a amostra para todos os países-anos para os quais temos dados para as variáveis controles, o resultado se mantém. De fato, a herança colonial britânica não parece ser um determinante da democracia. E tal resultado se repete em todos os modelos apresentados. Por conseguinte, **british** é descartado ao não se adequar ao primeiro dos dois critérios necessários para a identificação adequada de uma variável endógena por meio de um instrumento.

---

pode ser o fato que limitamos nossa análise a apenas aos países-anos que possuem informação sobre desigualdade econômica (n=3811). Se a expandirmos a amostra para toda a população (n=6439) para qual temos informações sobre as variáveis de controle, os sinais permanecem iguais. No modelo da coluna (2), as variáveis **difmundo** e **difcont** permanecem significantes e negativamente associados com democracia a 90% e 95% de confiança. E **difregião** também permaneça significante e positivamente relacionado à 99%. Já nos modelos da coluna (1) **difmundo** torna-se positivo e insignificante, **difcont** permanece negativo e insignificante e **difregião** positivo e significante à 99%. Concluindo, é possível perceber com os resultados apresentados que o fenômeno da difusão de democracia é muito mais complexo que o teorizado na literatura e constituí um campo aberto e que deve ser alvo de estudos mais aprofundados.

Tabela 8 – Democracia defasada$_{(t-1)}$ com efeitos fixos continentais

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
difmundo$_{(t-2)}$	**-0.550***	**-0.522***		-0.457	
	0.307	**0.288**		0.286	
F-test	**3.21***	**3.29***		2.55	
difcont$_{(t-2)}$	-0.139	**-0.614****		**-0.640****	**-0.684****
	0.224	**0.252**		**0.252**	**0.251**
F-test	0.38	**5.92****		**6.47****	**7.40****
difregião$_{(t-2)}$	**0.435****	**0.547*****		**0.580*****	**0.579*****
	0.137	**0.137**		**0.137**	**0.137**
F-test	**10.03****	**16.02*****		**17.87*****	**17.94*****
difpond1$_{(t-2)}$	**0.747****				
	0.321				
F-test	**5.43****				
difpond2$_{(t-2)}$	**0.219***				
	0.117				
F-test	**3.51***				
horiental	-0.176		**-0.214***	**-0.201***	**-0.201***
	0.108		**0.109**	**0.105**	**0.105**
F-test	2.63		**3.87***	**3.65***	**3.65***
british	- 0.005		0.012		
	0.065		0.066		
F-test	0.01		0.03		
llong	0.137		**0.177****	**0.208****	**0.209****
	0.095		**0.082**	**0.076**	**0.076**
F-test	2.09		**4.66****	**7.48****	**7.54****
N	3781	3781	3811	3781	**3781**
F-test para todos instrumentos		**5.80*****	**2.48***	**5.41*****	**6.52*****

Erros Padrões robustos e clusterizados por país.

Significância coeficientes e Testes F: *< 0,1 / **< 0,05 / *** <0,01

Na coluna (4) incluímos os dois conjuntos de instrumentos em um único modelo: as três mensurações de difusão de democracia e as variáveis longitudinais. Com exceção apenas da **difmundo**, todos outros instrumentos estão relaciona-

dos com democracia. **Difregião** é positiva e significantemente associado com democracia à 99% de confiança, tendo apresentado um teste F superior à 10 em todas as colunas, o que permite, portanto, uma identificação forte da variável democracia. **Difcont** e longitude estão associados à 95% e o indicador hemisférico à 90%, sendo que o teste F de **llong** também se aproxima do limiar estabelecido por Staiger e Stock (1997). O teste F de todos os instrumentos é de 5.41.

Por fim, no modelo final de identificação – coluna (5) – mantemos apenas as variáveis da coluna (4) que foram significantes a no mínimo 90% de confiança[98]. Nesta primeira especificação com efeitos fixos continentais o modelo final é composto das seguintes variáveis: **difcont, difregião, llong e horiental.** O segundo é significante a 99%, o primeiro e o terceiro a 95%, e o quarto a 90%, sendo o teste F do modelo da coluna (5) 6.52 ligeiramente superior ao F da coluna (4).

Na Tabela 9 reproduzimos a mesma análise incluindo além dos efeitos fixos para os cinco continentes, o controle de choques temporais exógenos (*dummies* de ano). Os resultados das variáveis de difusão são bastante semelhantes: **difmundo** e **difcont** continuam com sinais negativos enquanto **difregi**ão possui sinal positivo. E se repetirmos o modelo incluindo todos os dados para o qual temos informações das variáveis controles (N=6439), os resultados se repetem: **difmundo** e **difcont** são ambas negativamente relacionadas com democracia, mas só a primeira é significante a 99% de confiança enquanto a outra não atinge os limiares tradicionais de significância. Já **difregi**ão permanece com sinal positivo e fortemente significante.

[98] Os testes empíricos demonstram que a inclusão de um instrumento de difusão que não tenha relação significativa com democracia reduz a eficiência da estimação e do método de identificação. Diante disso, optamos por excluí-los. Os testes utilizados para tal avaliação são os testes de Kleibergen-Paap de subidentificação e fraca identificação e a estatística J de Hansen sobreidentificação.

Tabela 9 – Democracia defasada$_{(t-1)}$ com efeitos fixos continentais e temporais

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
difmundo$_{(t-2)}$	**-141.17*** **	**-141.46**** **		**-140.44*** **	**-141.07*** **
	2.642	**2.753**		**2.803**	**2.742**
F-test	**2854.64*** **	**2640.02*** **		**2511.40*** **	**2647.55*** **
difcont$_{(t-2)}$	-0.247	**0.253*** **		**0.245*** **	**0.287*** **
	0.238	**0.067**		**0.069**	**0.066**
F-test	1.08	**14.03*** **		**12.46*** **	**18.59*** **
difregião$_{(t-2)}$	**0.42** **	0.037		0.042	
	0.142	0.026		0.027	
F-test	**8.86** **	1.98		2.50	
difpond1$_{(t-2)}$	**0.720** **				
	0.357				
F-test	**4.07** **				
difpond2$_{(t-2)}$	**0.209* **				
	0.126				
F-test	**2.77* **				
horiental	-0.174*		**-.212* **	**-0.043** **	**-0.043** **
	0.109		**0.109**	**0.021**	**0.021**
F-test	2.54		**3.75* **	**4.15** **	**4.15** **
british	-0.006		0.011		
	0.065		0.067		
F-test	0.01		0.03		
llong	0.137		**0.178** **	**0.024* **	0.021
	0.094		**0.082**	**0.013**	0.013
F-test	2.12		**4.68* **	**3.29* **	2.39
N	3781	3781	3811	3781	3781
F-test para todos instrumentos		**1067.35*** **	**2.45* **	**723.22*** **	**856.09*** **

Erros Padrões robustos e clusterizados por país.
Significância: *< 0,1 / **< 0,05 / *** <0,01

Por outro lado, quando analisadas em conjunto, **difmundo** é a variável com maior poder explicativo, pois possui teste F muito superior a qualquer outro teste F da Tabela 9, incluindo a comparação com as variáveis ponderadas **difpond1** e **difpond2**. Mais uma vez encontramos evidências que a melhor estratégia de identificação de democracia é a introdução conjunta das três variáveis de difusão puras. Ademais, quando **difcont** é um instrumento junto com as outras duas variáveis de difusão, ela também possui um teste F superior a 10.

O fator que determina o crescimento exponencial dos coeficientes e da significância da variável **difmundo** é a introdução das *dummies* de ano, uma vez que em cada ano o grau de difusão de democracia no mundo é por definição semelhante para todos os países. Desta forma, boa parte da variação deste dado foi capturada pelas *dummies* de ano e a pequena variação restante é sensivelmente relacionada com democracia[99].

No que se refere aos outros três instrumentos, o mesmo resultado se repete. Os padrões encontrados na Tabela 8 não são alterados. A longitude e o indicador hemisférico são variáveis insignificantes quando instrumentos únicos. Contudo ao serem colocadas ao mesmo tempo no modelo, ambas atingem significância estatística a 95% e 90% de confiança, respectivamente,

[99] Existe uma pequena diferença entre democracias e desigualdades em cada ano em todas as mensurações puras de difusão de democracia, pois quando um país é democrático, ele deve ser retirado tanto do denominador quanto do numerador da fórmula, enquanto quando um país é autoritário é retirado apenas do denominador. Supondo, por exemplo, que existam 50 países e 20 sejam democráticos. Para os países autoritários, o valor de **difmundo** é de 20/49 enquanto para os países democráticos esse valor é de 19/49. Esta diferença decorre da necessidade de se retirar o próprio país da contagem de difusão nas três circunscrições geográficas. Caso o próprio país fosse incluído no número de democracias e no número de ditaduras, as variáveis de difusão tornar-se-iam endógenas ao próprio regime político do país e deixariam de ser instrumentos adequados.

enquanto o indicador de "herança colonial britânica" permanece insignificante em todos os modelos, resultado também repetido na Tabela 10.

No modelo da coluna (4), incluímos os dois conjuntos de instrumentos em um único modelo. Incluímos as três mensurações de difusão de democracia e também as variáveis longitudinais. As duas variáveis mais agregadas de difusão foram significantes e os testes Fs do modelo como um todo e das variáveis **difmundo** e **difcont** são superiores a 10. Por outro lado, diferentemente do resultado da especificação apenas com efeitos fixos continentais, a variável **difregião** não é significante. Já as duas variáveis de longitude são significantes e possuem os mesmos sinais da Tabela 8.

Posto isto, encontramos mais uma vez indícios de que a melhor forma de identificar a democracia é a utilização dos instrumentos de difusão e de localização longitudinal do país, não obstante para a especificação com efeitos fixos continentais e temporais utilizamos apenas **difmundo** e **difcont** como variáveis de difusão. O modelo final com todos os instrumentos é apresentado na coluna (5), onde llong está ligeiramente acima do limite de 90% de significância.

Por fim, na Tabela 10 reproduzimos os mesmos modelos, mas agora incorporamos efeitos fixos para os dez subcontinentes (ou regiões) além das *dummies* de ano, o que reduz de forma considerável a variabilidade dos dados. Os resultados continuam sendo mais robustos nesta especificação para a variável **difmundo** e **difcont.** Na primeira coluna da tabela, com exceção da variável de **difmundo,** todas as outras possuem relações estatisticamente insignificantes com democracia, o que é uma decorrência do fato que boa parte da variação dos dados é captado pelo conjunto de *dummies* temporais e regionais.

Tabela 10 – Democracia defasada$_{(t-1)}$ com efeitos fixos regionais e temporais

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
difmundo$_{(t-2)}$	**-140.65*** **	**-141.28*** **		**-140.26*** **	**-140.73*** **
	2.55	**2.695**		**2.76**	**2.66**
F-test	**3049.61*** **	**2748.84*** **		**2582.84*** **	**2792.77*** **
difcont$_{(t-2)}$	-0.317	**0.221** **		**0.213** **	**0.297*** **
	0.239	**0.073**		**0.072**	**0.65**
F-test	1.76	**9.12** **		**8.77** **	**20.80*** **
difregião$_{(t-2)}$	0.247	0.076		**0.09***	
	0.201	0.052		**0.507**	
F-test	1.50	2.09		**3.33***	
difpond1$_{(t-2)}$	0.084				
	0.373				
F-test	0.05				
difpond2$_{(t-2)}$	0.054				
	0.137				
F-test	0.16				
horiental	-0.158		-0.188	**-0.051** **	**-0.489** **
	0.119		0.117	**0.024**	**0.235**
F-test	1.75		2.58	**4.56** **	**4.31** **
british	-0.062		-0.059		
	0.065		0.065		
F-test	0.91		0.83		
llong	0.161		**0.209** **	**0.032***	**0.295***
	0.107		**0.095**	**0.017**	**0.017**
F-test	2.23		**4.82** **	**3.33** **	**3.12***
N	3781	3781	3811	3781	3781
F-test for all instruments		**5850.65*** **	**2.31***	**811.05*** **	**904.53*** **

Erros Padrões robustos e clusterizados por país.

Significância: *< 0,1 / **< 0,05 / *** <0,01

Por outro lado, nos modelos da coluna (2) e da coluna (4) as outras variáveis puras de difusão, **difcont** e **difregião** recuperam a significância estatística e, inclusive, a primeira fica com um teste F muito próximo de 10. Já os outros dois conjuntos de variáveis apresentam um comportamento bem semelhante ao encontrado nos dados anteriores. As variáveis de longitude só ganham significância quando ambas fazem parte do modelo. Na coluna (3) longitude já é significante e na coluna (4) as duas o são (**llong** e **horiental**). Por sua vez, repetindo os resultados das duas tabelas anteriores, o indicador da herança colonial britânica, **british,** é não significante e inclusive mantém o sinal negativo.

Diante desses resultados semelhantes nas colunas (1), (2) e (3), optamos por incluir na identificação de democracia da coluna (4) as seguintes variáveis **difmundo** e **difcont, difregião, llong** e o indicador hemisférico **horiental.** O resultado final da Tabela 10 é o único no qual as três variáveis de difusão puras são significantes, ainda que **difregião** esteja no limite tolerável ao ter um p-valor de 0.90. Posto isso, podemos verificar que nas três especificações a única variável presente em todos os modelos finais é **difcont**, apesar de ter trocado de sinal com a introdução das dummies de tempo. **Difmundo,** por sua vez, é sempre negativo, mas não significante na primeira especificação com apenas efeitos fixos continentais. Após a inclusão das dummies de ano torna-se fortemente associada com democracia em todas as especificações. E já a variável **difregião** é positiva em todos os modelos, mas confortavelmente significante apenas no primeiro modelo que não incorpora os choques temporais. As variáveis **llong** e **horiental** são significantes e bem estáveis em todos os modelos apresentados. Por fim, na coluna (5) da Tabela 10 apresentamos o modelo sem a

variável **difregião** por razões que serão enunciadas nos próximos parágrafos[100].

Após apresentarmos extensamente a escolha das variáveis do primeiro estágio do modelo, discutimos alguns dos testes estatísticos que permitem verificar se os modelos finais de cada especificação identificam fortemente democracia ou não. Todas as estatísticas apresentadas nesta seção foram estimadas a partir de modelos lineares condicionais à média e em painel empilhado. Para mais informações sobre os testes de identificação por variável instrumental de regressores endógenos ver Baum, Schaffer e Stillman (2007).

No modelo com efeitos fixos continentais, apresentado na coluna 5 da Tabela 8, os testes *Kleibergen-Paap* rejeitam as hipóteses nula de *subidentificação* e de *fraca identificação* com F de, respectivamente, 9.85 e 6.52. E a estatística J de Hansen aceita a hipótese nula de sobreidentificação dos instrumentos à 10%. Por fim, o teste de endogeneidade do indicador de democracia rejeita a hipótese nula de que esta variável possa ser tratada como exógena a 5%.

Já no modelo com efeitos fixos continentais e temporais apresentado na coluna 5 da Tabela 9, a estatística J de Hansen só aceita a hipótese nula de sobreidentificação dos instrumentos a 10% e não a 5%, ainda que melhore substancialmente a rejeição das hipóteses nulas de *subidentificação* e de *fraca identificação* nos testes *Kleibergen-Paap* para 59.51 e 856.01,

[100] A inclusão desta variável faz com que o modelo rejeite a hipótese nula de sobreidentificação de todos os instrumentos da estatística J de Hansen.

respectivamente. E o teste de endogeneidade do indicador de democracia aceita a hipótese nula de que esta variável seja exógena a mais de 40%.

Finalmente, no modelo com efeitos fixos regionais e temporais, a estatística J de Hansen rejeita a hipótese nula de que o modelo é sobreidentificado a 5% (p-valor: 0.04), além de os testes *Kleibergen-Paap* de *subidentificação* e de *fraca identificação* serem de 61.09 e 810.15 respectivamente. Devido a este resultado da estatística J de Hansen, optamos por excluir a variável **difregiao** da lista de instrumentos da especificação com efeitos fixos regionais e temporais pois era a única variável de difusão significante à 10%, mas não a 5%. Com isto, estatística J de Hansen aceita a hipótese nula de que o modelo é sobreidentificado à 4%, além de os testes *Kleibergen-Paap* de *subidentificação* e de *fraca identificação* serem de 60.50 e 904.53, respectivamente. Logo, a especificação com efeitos fixos regionais e temporais terá a mesma lista de instrumentos da especificação com efeitos fixos continentais e temporais: **difmundo, difcont, horiental** e **llong.** Por fim, o teste de endogeneidade do indicador de democracia rejeita a hipótese nula de que esta variável possa ser tratada como exógena a 5%.

Em todas as especificações do 1º passo os instrumentos identificam fortemente democracia, atendendo ao primeiro critério da estimação por variável instrumental. Independentemente da especificação (com ou sem efeitos fixos temporais, regionais e/ou continentais) incluímos dois conjuntos de instrumentos – **variáveis de difusão e de longitude dos países**

Como última etapa da análise da adequabilidade do método, também é importante avaliar a plausibilidade do segundo

critério da estimação por variável instrumental. Isto é, a validade ou não da hipótese da restrição de exclusão. Não existe um teste específico para tal que seja semelhante aos testes que acabamos de avaliar para identificar quais instrumentos são fortemente correlacionados com a variável endógena. Contudo é possível verificar se, na presença de outros instrumentos fortes, a difusão democrática ou a longitude de um país é relacionada com a desigualdade econômica. Diante disso, por meio de uma especificação de modelos lineares condicionais à média e em painel empilhado, testamos se as variáveis de difusão e de longitude são relacionadas com a desigualdade econômica, após usarmos nossos próprios instrumentos para purificar democracia da potencial endogenia. O fato de termos sobreidentificado democracia em todos os modelos nos dá a flexibilidade necessária para testar a hipótese de restrição de exclusão por meio de múltiplos testes de Wald.

Fazemos isso de duas formas distintas. Na primeira testamos no 2º passo do método cada variável instrumental isoladamente, enquanto as outras três permanecem como instrumentos no 1º passo. E na segunda testamos os conjuntos de variáveis de difusão e de longitude separadamente. O exercício é aproveitar que em nossos modelos sobreidentificamos democracia, tal como comprovado pela estatística J de Hansen, e dessa forma podemos trabalhar com estas variáveis testando se algum dos instrumentos são covariáveis que afetam ou não desigualdade. Apresentamos os resultados deste exercício para as três especificações finais apresentadas nas colunas (5) das Tabelas 8, 9 e 10.

Tabela 11 – Testes de endogeneidade

Potenciais Instrumentos como Covariável Única no 2º passo.			
	Efeitos Fixos Continentais	**Efeitos Fixos Continentais e Temporais**	**Efeitos Fixos Regionais e Temporais**
$difmundo_{(t-2)}$	-	7.347	65.895
	-	20.358	325.651
$difcont_{(t-2)}$	2.968	1.822	0.742
	2.675	2.504	2.408
$difregiao_{(t-2)}$	2.288	-	-
	1.850	-	-
horiental	2.375	0.990	0.909
	1.938	1.255	1.297
llong	1.122	**1.722****	1.423
	1.231	**0.743**	2.979
Potenciais Instrumentos como Covariáveis Conjuntas no 2º passo.			
$difmundo_{(t-2)}$	-	-12.352	0.000
		13.141	26.296
$difcont_{(t-2)}$	0.703	1.831	0.710
	4.204	2.496	2.396
$difregião_{(t-2)}$	2.069	-	-
	2.780	-	-
horiental	2.254	0.604	0.666
	1.944	1.243	1.278
llong	0.246	**1.633****	1.253
	1.340	**0.705**	0.971
N	3781	3781	3781

Erros Padrões robustos e clusterizados por país.

Significância: *< 0,1 / **< 0,05 / *** <0,01

Conforme podemos ver na Tabela 11, o resultado das especificações que controlam para efeitos continentais e efeitos regionais temporais indica que os instrumentos não sofrem de endogeneidade. Já a especificação de efeitos fixos continentais e temporais tem um de seus instrumentos relacionados com desigualdade econômica – o posicionamento longitudinal **llong**

No primeiro modelo, todas as variáveis instrumentais são insignificantes quando inseridas como covariáveis do 2º passo. Quando inseridas isoladamente, os menores p-valores são das variáveis **difregiao** e **horiental** (p-valor: 0.22) e os outros são de 0.26 para **difcont** e 0.36 para **llong** e quando inseridos em conjunto com a outra variável do grupo, o menor p-valor é de **horiental** (p-valor: 0.25), enquanto os outros valores são maiores: **difregião** – 0.46; **llong** – 0.85; **e difcont** – 0.87. No segundo modelo a variável **llong** tem efeito significativo sobre desigualdade econômica tanto quando inserida isoladamente como covariável como quando inserida junto com a outra variável de longitude. Posto isto, o uso destas quatro variáveis instrumentais é inadequado na especificação com efeito fixo continental e temporal. Diante de tal fato, optamos por rever o resultado da Tabela 9 e propomos como instrumentos finais de identificação de democracia apenas **difmundo, difcont** e **horiental**[101]**.** Finalmente, no terceiro modelo, no qual

[101] O modelo final para esta especificação elimina, consequentemente, **llong** do rol de instrumentos. O resultado final do 1º passo indica que os três instrumentos restantes são significantes: **difmundo** e **difcont** à 1% e **horiental** à 10%. Neste novo modelo a estatística J de Hansen passa a aceitar a hipótese nula de sobreidentificação dos instrumentos a mais de 35% e os resultados dos testes de *subidentificação* e de *fraca identificação* permanecem bastante satisfatórios; 59.03 e 1068.7, respectivamente. Por fim, nos testes de endogeneidade nenhum dos instrumentos é um determinante de desigualdade econômica, seja entrando

incluímos efeitos fixos regionais e temporais, os quatro instrumentos são insignificantes em todos os modelos. Os p-valores, isolados e em conjunto respectivamente, são: para **difmundo**: 0.84 e 1.00; para **difcont:** 0.75 e 77; para **horiental** 0.49 e 0.60; e, finalmente, para **llong**: 0.63 e 0.20.

Desta forma, finalizamos essa seção concluindo que o método de estimação da relação de democracia sobre a desigualdade econômica por meio de variáveis instrumentais de difusão e de longitude é apropriado. Ambos os critérios para a validade de um instrumento são atendidos. Os conjuntos de instrumentos identificam adequadamente a variável endógena, pois além de estarem fortemente relacionada com a variável endógena, não estão correlacionadas com a variável dependente e, por consequência, com o termo de erro $\boldsymbol{\varepsilon}_{it}$ do 2º passo (hipótese de restrição de exclusão).

4.2 Democracia e desigualdade econômica

O segundo desafio metodológico é a estimação dos efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica. Conforme expusemos anteriormente, o método mais adequado para responder a essa questão é a regressão quantílica apresentada no Capítulo 2. Posto isso, o único ponto a ser esclarecido antes de começarmos a expor os achados é o formato do resultado apresentado no *output* do modelo. Na realidade, tradicionalmente, os modelos de regressão quantílica são apresentados por meio de um *output* gráfico. Isto porque a regressão quantílica é usada como ferramenta

---

como covariável única ou como covariável conjunta no 2º passo da equação.

tradicional de estimação dos efeitos heterogêneos de uma variável independente sobre uma variável dependente contínua e para o tal é necessário estimar inúmeras regressões ao longo dos diferentes quantis condicionais da distribuição da variável dependente.

Os resultados da regressão quantílica são de fato o resultado de inúmeras regressões semelhantes, que variam apenas em relação τ *-ésimo quantil condicionado.* Isto porque, por exemplo, para estimar os efeitos ao longo dos 9 diferentes decis de uma distribuição é necessário estimar nove regressões distintas que variam entre os τ de $\tau = 0.1$ a $\tau = 0.9$. Por outro lado, apesar dessa especificidade do método, a interpretação dos efeitos é semelhante às interpretações dos coeficientes das regressões lineares por MQO. E a opção do *output* gráfico tem como fundamento a maior facilidade para analisar a heterogeneidade dos efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica do que a apresentação de uma série de tabelas de regressão com o mesmo conjunto de variáveis e diferentes apenas em relação aos quantis condicionais τ[102].

---

[102] Ademais, tal como explicitamos anteriormente, a regressão quantílica é utilizada no 2º passo da estimação por variável instrumental. Os pormenores do 1º passo foram apresentados na seção anterior e por isso podemos considerar que a variável independente de interesse dos modelos quantílicos é uma nova variável independente de democracia [**demo**], purificada – teoricamente – dos problemas de causalidade reversa.
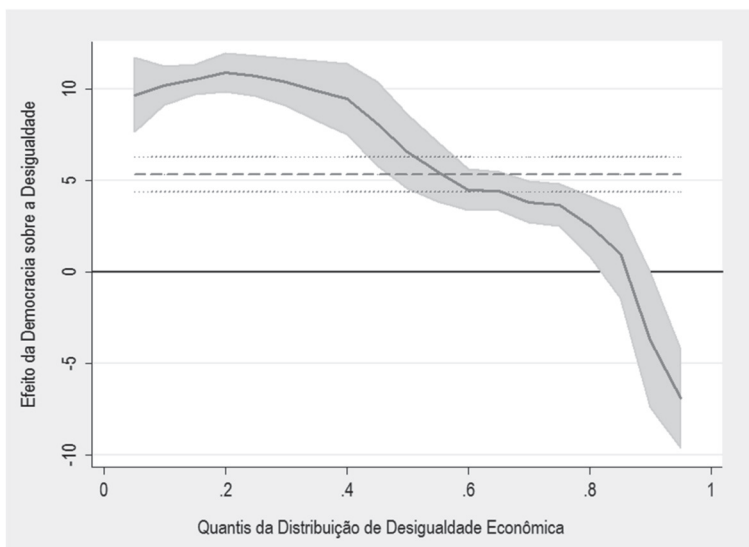
Gráfico 14 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais
Fonte: CGV e UTIP-EHII

Na série de gráficos que apresentamos mantemos um padrão uniforme de exposição dos dados. No eixo horizontal estão dispostos os quantis da distribuição de desigualdade econômica entre os países-anos, estando à esquerda os países-anos mais iguais e à direita os países-anos mais desiguais. Cada quantil refere-se à posição do caso na distribuição. O quantil 0.1 indica os casos que dividem os 10% anos/países mais iguais dos outros 90% entre 1963 e 2008. Já o intervalo entre o quantil 0.4 e 0.6 abrange os 20% de casos localizados exatamente no centro da distribuição da desigualdade. E o quantil 0.9 indica os casos que dividem os 10% anos-países mais desiguais do restante 90% da amostra. No eixo vertical encontramos os efeitos estimados da democracia sobre a

desigualdade em cada um dos quantis do eixo horizontal. Efeitos negativos indicam que a democracia possui uma relação inversa com a desigualdade: quanto mais democrático menos desigual. Já efeitos positivos indicam que a democracia possui uma relação de mesma direção: quanto mais democrático, mais desigual[103].

Além dos efeitos heterogêneos da democracia que são apresentados na reta contínua, também indicamos em cinza os intervalos de confiança de cada um dos pontos estimados, todos condicionados no quantil de desigualdade. Estimamos os intervalos de confiança a 90% por meio do método de bootstrap de forma a tornar válida as inferências causais realizadas.

Do mesmo modo, apresentamos uma linha horizontal tracejada que indica o resultado de uma regressão em MQO e seu respectivo intervalo de confiança[104]. Além das curvas estimadas, inserimos em todos gráficos uma linha horizontal de referência que assinala o limite do efeito nulo de democracia. Esta linha (preta contínua e mais fina) tem como função separar os quantis nos quais os efeitos da democracia são positivos dos quantis onde os efeitos são negativos.

No conjunto de gráficos apresentamos diversos modelos de regressão quantílica em diferentes especificações, que

---

[103] O impacto negativo da democracia sobre a desigualdade econômica é definido do ponto de vista estatístico, o que significa que a democracia e a desigualdade variam inversamente: isto é, quanto maior uma, menor a outra. Os termos impactos positivo e negativo estão sendo utilizados segundo este prisma de covariação estatística e nunca segundo um ponto de vista normativo, no qual o efeito da democracia seria bom (positivo) quando reduzisse a desigualdade econômica.

[104] Na regressão de MQO estimamos o efeito médio da democracia sobre a desigualdade econômica. Obviamente este modelo, embora bastante difundido, não é o adequado para o estudo de nosso problema de pesquisa, uma vez que não permite a estimação dos efeitos da desigualdade em diferentes pontos da distribuição. E esta é a razão pela qual em todos os gráficos o resultado do modelo de MQO é uma reta paralela ao eixo horizontal.

variam de acordo com os dados de democracia e desigualdade e entre os diferentes efeitos fixos inseridos. Nesta segunda seção do capítulo utilizamos os dados do CGV para medir democracia e do EHII para a desigualdade econômica. No próximo capítulo analisamos a relação usando os outros dados de desigualdade e democracia apresentados no capítulo 3. Em todos os modelos incluímos o mesmo vetor de variáveis controles citados na primeira nota de rodapé deste capítulo e na Tabela 7 do capítulo 3.

O Gráfico 14 (p. 197) apresenta a relação entre democracia e desigualdade na especificação com efeitos fixos continentais, utilizando os quatro instrumentos listados na Tabela 8. Neste gráfico fica claro que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são fundamentalmente heterogêneos e o suposto sobre a homogeneidade dos efeitos é equivocado. O Gráfico 14 não deixa dúvidas de que os resultados apresentados por modelos lineares condicionais à média (MQO) – a reta horizontal tracejada – que no caso indicam que a democracia está positivamente associada com a desigualdade, refletem de maneira inadequada e reduzem em muito a complexidade da relação entre democracia e desigualdade. Por outro lado, é interessante notar como a regressão de MQO é de fato um sumário da relação média entre desigualdade e democracia, indicando um efeito médio e positivo da democracia em torno de 5.3 pontos de GINI. Contudo, o custo desta sumarização é a inflexibilidade para captar os pormenores de como o contexto socioeconômico no qual opera a democracia afeta os efeitos do regime político sobre a desigualdade.

Os efeitos da democracia só se tornam negativos ao final da distribuição, mais especificamente nos 13% países-anos mais desiguais durante todo o período analisado, justamente

os países-anos nos quais é muito maior a probabilidade do surgimento de uma demanda por redistribuição no seio da cidadania e onde o cálculo do custo benefício da adoção de plataforma eleitoral e políticas públicas que foquem esse problema pelos partidos é mais favorável. Já nos primeiros 40% dos países-anos mais iguais de toda a amostra (os quatro primeiros decis da distribuição), existe um efeito um tanto homogênea e estável da democracia sobre a desigualdade, mais ou menos em torno de um efeito positivo de 10 pontos de GINI. A partir do 4º decil, o aumento da desigualdade parece, monotonicamente, amenizar os efeitos positivos da democracia até o ponto que essa gradativa suavização cruza o valor zero (a linha referencial do efeito nulo) e o efeito da democracia sobre a desigualdade torna-se negativo.

Resumindo, de acordo com o resultado do Gráfico 14, a democracia aumenta a desigualdade de maneira substancial entre os países-anos mais iguais e após certo nível de desigualdade seus efeitos positivos são arrefecidos monotonicamente, até que nos países-anos mais desiguais da amostra os seus efeitos tornam-se verdadeiramente negativos.

Este padrão encontrado está de acordo com a narrativa político-econômica a respeito dos efeitos da democratização no Leste Europeu e na América Latina. Enquanto naqueles países mais iguais do mundo, recém-saídos da experiência comunista-soviética, o surgimento da democracia foi acompanhado de um substancial aumento da desigualdade econômica, na América Latina – a região economicamente mais desigual do globo – o esforço do projeto democrático dos últimos 25 anos foi em direção à criação de políticas que reduzam as disparidades econômicas entre os indivíduos.

Este primeiro resultado indica, portanto, que: 1) a relação entre democracia e desigualdade não deve ser tratada

como homogênea e nem seus efeitos são monotônicos ao longo da distribuição da desigualdade; 2) existe uma relativa homogeneidade dos efeitos da democracia no início da distribuição de desigualdade, e só apenas quando um país-ano atinge níveis intermediários de desigualdade é que a democracia passa a ter seus efeitos positivos amenizados; e, por fim, 3) é apenas no final da distribuição que a democracia age de maneira mais contundente na redução da desigualdade, o que parece indicar um limiar básico a partir do qual a competição política democrática passa a ter como tema principal a efetiva redução da desigualdade econômica.
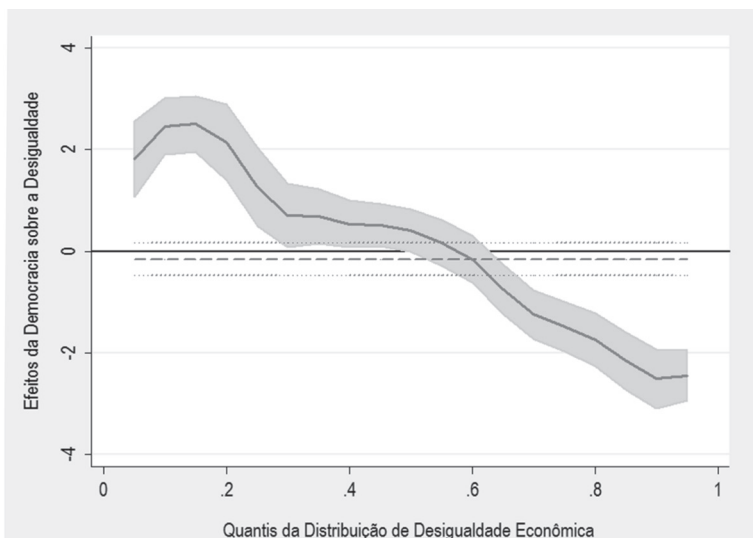
Gráfico 15 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais e temporais
Fonte: CGV e UTIP-EHII

No Gráfico 15 repetimos a mesma estimação, mas agora usando a segunda especificação com efeitos fixos continentais

e efeitos temporais para o controle de choques exógenos. O vetor de variáveis controles permanece o mesmo. O gráfico corrobora o anterior, demonstrando que mesmo com a adição de dummies de ano, os efeitos da democracia sobre a desigualdade são fundamentalmente heterogêneos e a abordagem tradicional que assume efeitos homogêneos é equivocada. Contudo, ainda que o formato seja muito semelhante, o Gráfico 15 apresenta algumas diferenças a respeito dos patamares dos efeitos estimados. O primeiro ponto é que nesta especificação o efeito médio da democracia sobre a desigualdade é nulo, uma vez que o seu intervalo de confiança cruza o zero do eixo vertical. Já os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade não são exclusivos apenas dos 13% países-anos mais desiguais. A partir do 57º centil (ou os 43% países-anos mais desiguais), os efeitos da democracia sobre a desigualdade são em direção à criação de uma sociedade cujos recursos são mais homogeneamente distribuídos entre os cidadãos.

Ademais, o ponto de estabilidade inicial dos efeitos positivos da democracia sobre a desigualdade abrange apenas os primeiros 20% países-anos mais iguais de toda a amostra (os dois primeiros decis da distribuição). A partir do intervalo entre o 2º e o 3º decil, os efeitos positivos da democracia em relação à desigualdade começam a ser amenizados monotonicamente até que, próximo ao 6º decil, a linha do efeito nulo é atravessada e a democracia começa a operar em direção à redução da desigualdade. Os maiores efeitos negativos estão mais uma vez nos limites finais da distribuição, mas a magnitude é reduzida de - 7 pontos de GINI para apenas - 2.5 pontos.

Contudo, apesar das diferenças de magnitudes e valores, as 3 conclusões permanecem respaldadas: 1) a relação entre democracia e desigualdade é heterogênea e seus efeitos não

variam monotonicamente em toda a distribuição da desigualdade; 2) existe uma relativa homogeneidade dos efeitos da democracia no início da distribuição; e, por fim, 3) é apenas entre os países mais desiguais que a democracia age de maneira mais contundente na redução da desigualdade.

Finalmente, expandimos os controles da especificação, incluindo agora efeitos fixos regionais junto aos efeitos fixos temporais. O Gráfico 16 apresenta o resultado desta estimação. O vetor de controles permanece o mesmo e o vetor de instrumentos é o apresentado na coluna (5) da Tabela 10. Novamente os mesmos padrões empíricos são encontrados, indicando a veracidade da hipótese de os efeitos da democracia sobre a desigualdade serem heterogêneos e apenas nas sociedades mais desiguais a democracia opera da forma vislumbrada pelos filósofos políticos do século XIX: um sistema que traduz a igualdade política em uma busca por maior igualdade econômica.

O Gráfico 16 corrobora os anteriores, demonstrando que mesmo com a adição de região às *dummies* de ano, os efeitos da democracia sobre a desigualdade são fundamentalmente heterogêneos e a abordagem tradicional que assume efeitos homogêneos é equivocada. Contudo, ainda que o formato seja semelhante, algumas diferenças são importantes. Em primeiro lugar, a magnitude dos efeitos é menor, variando entre +1 no início da distribuição à -2 no final. Ademais, a estabilidade dos efeitos positivos da democracia sobre a desigualdade no início da distribuição se estende do 1º ao 4º decil, mas em uma magnitude bastante menor: um efeito de +0.3 pontos de GINI.
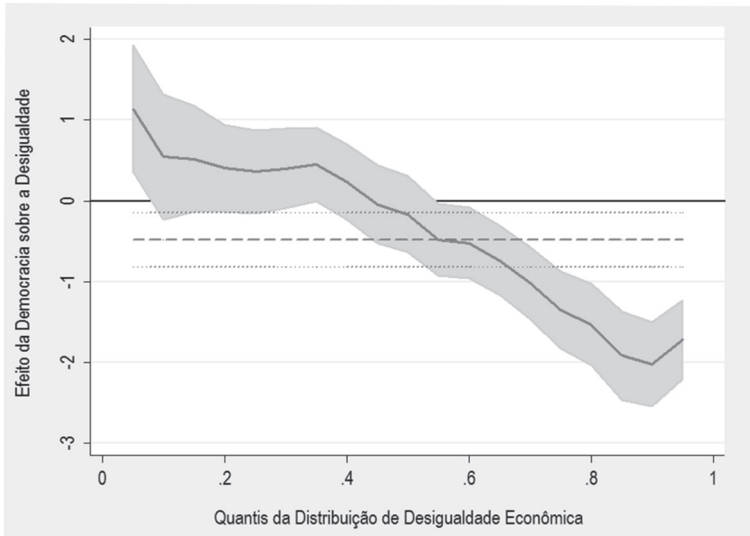
Gráfico 16 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos regionais e temporais
Fonte: CGV e UTIP-EHII

Os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade não são exclusivos apenas dos 13% ou 43% países-anos mais desiguais. Os efeitos tornam-se negativos (ainda que nesse ponto da distribuição estatisticamente não diferente de zero) no centil 45º, indicando que para mais de metade dos anos-países da amostra a democracia é uma instituição redutora da desigualdade econômica. E outra vez apenas no final da distribuição que os efeitos da democracia são mais fortes, atingindo -2 pontos de GINI.

Outra constatação surpreendente e bastante distinta dos dois resultados anteriores refere-se ao fato que o efeito médio estimado da democracia sobre a desigualdade na especificação com efeitos fixos regionais e temporais é negativo e significante (próximo de -0.5). Interessante observar que na especificação

apenas com efeitos fixos continentais os efeitos médios da democracia são positivos, na segunda com efeitos fixos continentais e temporais os efeitos são nulos e na especificação com efeitos fixos regionais e temporais os efeitos são negativos. Evidências contundentes que boa parte das dificuldades em se resolver as discussões a respeito de quais sejam os verdadeiros efeitos da democracia sobre a desigualdade decorre do pressuposto assaz equivocado que os efeitos da democracia são homogêneos, não sendo necessário contextualizá-los ao cenário socioeconômico sobre o qual a competição política ocorre. Por fim, mais uma vez verificamos que as 3 conclusões elencadas acima se confirmam.

Na Figura 1 apresentamos outros quatro modelos distintos. Selecionamos as especificações com efeitos fixos continentais e com efeitos fixos regionais e temporais (as que possuem no mínimo dois instrumentos identificadores de democracia para cada um dos conjuntos de variáveis de difusão e longitudinais), mas agora mantendo em cada uma das estimações apenas um dos conjuntos de variáveis instrumentais. Não reestimamos essa análise para a especificação com efeitos fixos continentais e temporais, pois nesta apenas a variável **horiental** atende aos dois requisitos de adequabilidade de um instrumento, enquanto **llong** está estatisticamente relacionada com EHII.

A Figura 1 apresenta quatro gráficos. Na metade superior estão as especificações com efeitos fixos continentais e na metade inferior as com efeitos fixos regionais e temporais. Ao lado direito do gráfico estão as especificações instrumentalizadas apenas pelas variáveis longitudinais enquanto no lado esquerdo estão aquelas instrumentalizadas pelas variáveis de difusão. Os testes estatísticos indicam que os dois modelos com apenas instrumentos de difusão são fortemente

identificados com democracia e não correlacionados com desigualdade econômica, atendendo os dois critérios de adequabilidade da estimação por variável instrumento. Por sua vez, nos dois modelos com apenas os instrumentos de longitude, os testes de Kleibergen-Paap não rejeitam a hipótese nula de subidentificação e a variável contínua de longitude **llong** não atende a hipótese de restrição de exclusão no modelo com efeito fixo continental, o que não torna estatisticamente válidos os resultados destes dois modelos.

Conforme podemos ver, os modelos do lado esquerdo que utilizam apenas as variáveis de difusão apresentam resultados bastante semelhantes aos expostos nos gráficos 14 e 16. Em ambos podemos tomar as mesmas conclusões de que a relação entre democracia e desigualdade é: 1) heterogênea e seus efeitos não variam monotonicamente em toda a distribuição da desigualdade iguais; 2) existe uma relativa homogeneidade destes efeitos positivos no início da distribuição; e, por fim, 3) é apenas no final da distribuição de desigualdade que a democracia age de maneira mais contundente na redução da desigualdade. Além do mais, os resultados também refletem as magnitudes dos efeitos encontrados. No modelo com efeito fixo continental são estimados efeitos que variam entre +10 e -9.5 e no modelo com efeitos fixos regionais e temporais são estimados efeitos que variam entre +1 e -2[105].

[105] Na apresentação gráfica e na discussão dos resultados efetivos em todos os gráficos e figuras desta pesquisa optamos por analisar os dados apenas entre o 5º e o 95º centil da distribuição para evitar que *outliers* deturpem os resultados. Por outro lado, se estimarmos os efeitos da democracia no último centil da distribuição, os resultados são sensivelmente mais poderosos no modelo com efeitos fixos continentais, onde a democracia reduz no 99º centil a desigualdade econômica em - 6 pontos de GINI enquanto no modelo com efeitos fixos regionais e temporais os efeitos são matizados e chegam a apenas -1.0 pontos.

Efeitos Fixos Continentais - Instrumentos de Difusão

Efeitos Fixos Continentais - Instrumentos de Longitude

Efeitos Fixos Regionais e Temporais - Instrumentos de Difusão

Efeitos Fixos Regionais e Temporais - Instrumentos de Longitude
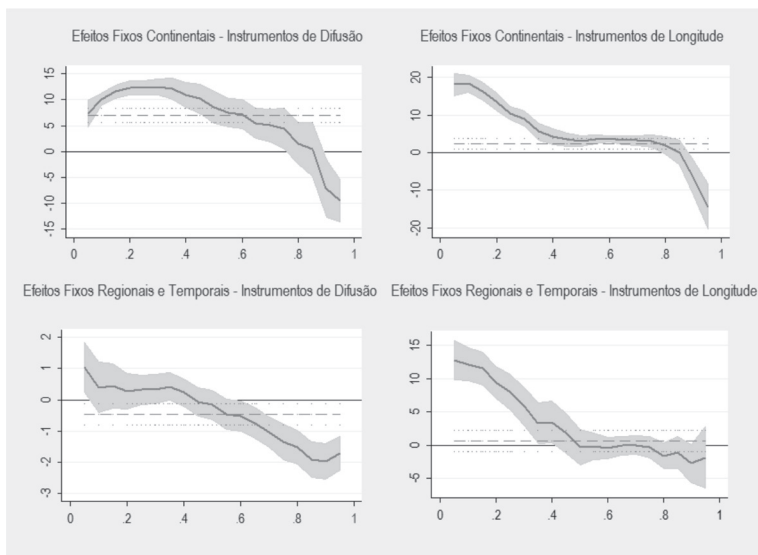
Figura 1 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - diferentes especificações e instrumentos
Fonte: CGV e UTIP-EHII

Já nos modelos com apenas instrumentos de longitude (que não identificam adequadamente os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica), algumas das conclusões não são verificadas. Por exemplo, no modelo com efeitos fixos continentais não há mais estabilidade dos efeitos da democracia nos países-anos mais iguais. Esta estabilidade é encontrada entre os países-anos medianamente desiguais. Por outro lado, os efeitos continuam sendo heterogêneos e não monotônicos e a democracia só reduz a desigualdade nos países-anos mais desiguais. Já no modelo com efeitos fixos regionais e temporais a democracia aumenta a desigualdade de maneira contundente nas sociedades mais iguais, mas os efeitos são monotonicamente decrescentes até se atingir a mediana da distribuição de

desigualdade, onde a democracia passa a ter efeitos que são negativos homogêneos mas não estatisticamente diferentes de zero (isto é, o intervalo de confiança perpassa a linha horizontal de efeito nulo).

Efeitos da Democracia sobre a Desigualdade
10
5
0
-5
-10
0
.2
.4
.6
.8
1
Quantis da Distribuição de Desigualdade Econômica
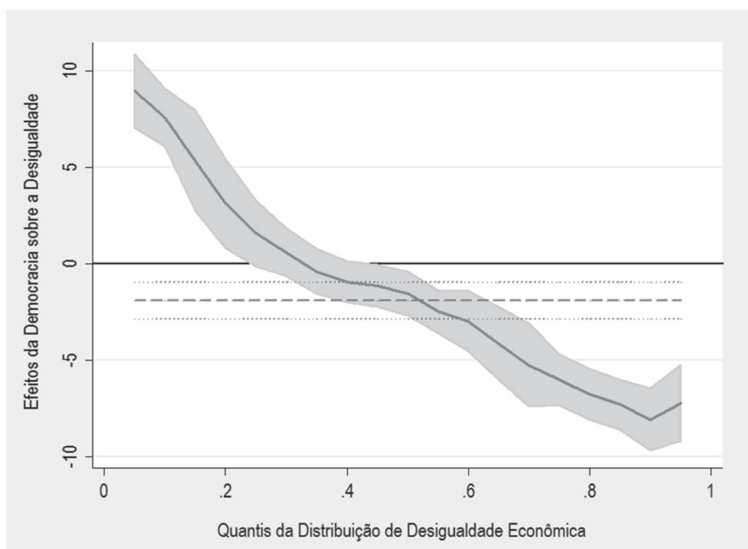
Gráfico 17 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - sem efeitos fixos
Fonte: CGV e UTIP-EHII

No Gráfico 17 introduzimos outra especificação da relação entre democracia e desigualdade desta vez sem qualquer controle regional, continental ou temporal. Esta é a especificação mais simples de toda a análise, pois excluí quaisquer tipos de efeitos fixos transversais ou temporais. Sublinhamos que para tal refizemos os passos feitos na seção anterior e usamos apenas os instrumentos que devidamente identificam democracia ao atenderem aos dois critérios necessários para a adequabilidade de um instrumento: a) estar fortemente relacionado

com a variável endógena e b) não ser correlacionado com a variável dependente e, por consequência, com o termo de erro $\boldsymbol{\varepsilon}_{it}$ do 2º passo (hipótese de restrição de exclusão). Nesta análise usamos como instrumentos apenas as variáveis de difusão mundial e regional, **difmundo** e **difregi**ã**o.**

Os resultados apresentados no Gráfico 17 mais uma vez reafirmam e confirmam a hipótese de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica são heterogêneos e afetados pelo contexto socioeconômico, no qual ocorre a competição política e eleitoral, sendo positivos entre as sociedades mais iguais e negativos entre as sociedades mais desiguais. Contudo, diferentemente dos achados dos modelos anteriores, a heterogeneidade dos efeitos parece variar de maneira monotônica conforme se amplia a desigualdade econômica. Não há na curva dos efeitos nenhuma aparente estabilidade. Por fim, mais uma vez se confirma a hipótese de que ao final da distribuição de desigualdade que a democracia age de maneira mais contundente para reduzir a desigualdade econômica, ainda que desde o 35º centil os efeitos da democracia sobre a desigualdade sejam negativos. Mas é exatamente no 9º decil que o efeito negativo é de maior magnitude: -8 pontos de GINI.

Após analisarmos todas as especificações para avaliar a relação e os efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade usando os dados do CGV e do EHII, iremos a partir de agora testar o quanto estes resultados empíricos resistem a diferentes formas de se analisar a relação e mesmo à alteração das medidas de desigualdade e de democracia. Nesta seção finalizamos a análise com a adoção de diferentes intervalos de

tempo como unidade básica de análise. E na seção seguinte introduzimos os dados do POLITY IV, SIID, SWIID e do BM-GINI e verificamos se a relação encontrada permanece.

Um importante ponto a ser discutido é que de agora em diante não apresentamos os resultados dos testes do 1º passo das próximas especificações. Contudo, de antemão enfatizamos que todo e qualquer modelo apresentado nas próximas seções possuem instrumentos que atendem aos dois critérios necessários para a validade da estimação por variável instrumental. Isto significa que tiveram resultados satisfatórios nos testes subidentificação e de fraca identificação de Kleibergen-Paap e nos testes de Wald para verificar se o instrumento é correlacionado de maneira significativa com democracia e se é não correlacionado com desigualdade, ambas decisões consideradas a 10% e a 5% de significância. Caso não encontremos nenhum conjunto de instrumentos que atenda aos critérios, não apresentamos aquela especificação e justificamos em quais testes os instrumentos falharam.

As primeiras especificações que não atendem aos critérios da metodologia de variável instrumental são aquelas que possuem apenas efeitos fixos regionais ou apenas temporais. Para ambas não encontramos um único conjunto de instrumentos que atendesse aos dois requisitos. Em quase todos ou a hipótese nula de não identificação não foi rejeitada a 10% ou algum dos instrumentos inclusos não eram estatisticamente significantes. E na única lista de instrumentos no qual a hipótese de não identificação foi rejeitada – os instrumentos **difmundo** e **difcont** com efeitos fixos temporais – os instrumentos não atenderam à condição de restrição de exclusão.

4.2.1 O problema dos dados faltantes

Um terceiro desafio desta pesquisa decorre do fato que utilizamos dados observáveis e que não são sempre compilados pelos países e instituições de pesquisa, impedindo que as conclusões obtidas com o arcabouço regressional em política comparada se aproximem do potencial inferencial de desenhos de pesquisa mais próximos do ideal experimental. Um dos problemas comuns decorrentes da natureza observacional da pesquisa é a existência de muitos dados faltantes, mesmo após uma criteriosa interpolação de dados. Uma importante consideração a ser feita sobre este ponto é a não independência do problema dos dados faltantes. É possível, por exemplo, que ditaduras divulguem menos dados sobre si mesmo do que democracias, assim como países menos desenvolvidos tendam a produzir menos dados que os países desenvolvidos, além de possuírem economias mais instáveis que tornam suas respectivas contas nacionais menos confiáveis.

Uma técnica amplamente utilizada na literatura para lidar com esse problema é a utilização de intervalos temporais maiores como unidade de análise[106]. É exatamente isto o que faremos nesta seção. Reestimamos a relação entre democracia e desigualdade utilizando como intervalo de dados não o país-ano, mas a média trienal, quinquenal, em uma década e em quinze anos das variáveis para cada país[107]. Contudo, antes de

---

[106] Está estratégia empírica foi feita nos principais estudos que tratam sobre os efeitos da democracia sobre a desigualdade, entre estes apontamos: Timmons (2010), Chong (2003), Reuveny e Li (2003) e Li, Squire e Zou (1998). O custo principal desta estratégia é a redução dos casos para análises inferenciais mais complexas, como as que propomos nessa pesquisa.

[107] No banco anual temos 46 unidades de tempo, no trienal 15 unidades e no quinquenal 11. Por sua vez, no banco por décadas temo 5 unidades de tempo e

estimarmos os novos modelos, verificamos por meio de uma regressão logística quais são os atributos dos países que aumentam a probabilidade da inexistência de dados sobre desigualdade econômica.

A coluna (2) da Tabela 12 apresenta os resultados de um modelo logístico que tem como variável dependente principal um indicador que demonstra se o dado sobre desigualdade econômica mensurado pelo EHII é faltante. Os dados que foram interpolados na amostra analisada são considerados como não faltantes. O modelo deixa claro que a existência de variáveis *missing* não é aleatória. Nesta coluna (2) apresentamos quais são possíveis determinantes da não divulgação de informações usando como lastro os países-anos. Os países não democráticos **[chga_demo]** têm 1.70 mais chances de ter a variável desigualdade não reportada. Além do regime político, o nível educacional da população masculina **[ihme_ayem]**, o nível de desenvolvimento **[lrgdpc]** e o tamanho do Gasto Público **[lgsg]** também estão negativamente associados com a não divulgação de informações sobre desigualdade, enquanto a abertura comercial **[lopenk]** e o papel do consumo no PIB **[lcsg]** estão associados de forma positiva.

Nas colunas (4) a (8) apresentamos a proporção de dados faltantes em cada uma das regiões e continentes analisados e como essa proporção é razoavelmente reduzida nos bancos de dados com intervalos de tempo maiores. Por exemplo, enquanto no banco de dados com intervalo de tempo anual

---

no banco com intervalo de 15 anos somente 3. Ficando claro que o preço a ser pago por estratégias deste tipo é uma redução da alavancagem inferencial dos dados. Muita informação é perdida neste processo de agregação, o que fica evidente que nos dados mais agregados em 10 e 15 anos os intervalos de confiança tornam-se maiores.

55% dos casos africanos são faltantes, essa proporção se reduz para 38% no banco com intervalo de tempo de 15 anos. Já na América, Ásia e em toda a amostra a redução de informações faltantes é de aproximadamente 15 pontos percentuais. As diferenças são menores para a Europa e a Oceania, justamente os continentes para os quais temos mais e menos informação, respectivamente.

Na Figura 2 usamos essas diferentes amostras e apresentamos os efeitos da democracia sobre a desigualdade ao longo da distribuição da variável dependente por intervalos de tempo trienais, quinquenais, por décadas e a cada quinzena de anos. Como método de identificação utilizamos as mesmas regras das seções anteriores para a identificação do conjunto de instrumentos mais adequados. Optamos por apresentar os dados na especificação apenas com efeitos fixos continentais, uma vez que já houve grande perda da variância dos dados com as agregações realizadas, sobretudo nas análises com intervalos de tempo de 10 anos e 15 anos. Contudo testamos os mesmos modelos para a especificação com efeitos fixos continentais e temporais e os resultados são bastante semelhantes. Sempre incluímos as variáveis instrumentais que identificam fortemente democracia sem ao mesmo tempo estarem relacionadas com desigualdade.

Tabela 12 – Dados faltantes de desigualdade econômica

M. Logístico	**Painel Anual**	**(3)**	**(4)**	**(5)**	**(6)**	**(7)**	**(8)**
chga_demo	**-0.63*****	**Missings**	**Ano - pais**	**3 anos**	**5 anos**	**10 anos**	**15 anos**
	0.07						
lrgdpc	**-0.25*****	**África**	**55.3%**	**50.8%**	**52.3%**	44.4%	37.9%
	0.05	Af. Norte e Oriente Médio	41.8%	39.4%	41.1%	32.3%	30.3%
wdi_urban	-0.00	Af. Subsaariana	61.2%	55.8%	57.2%	49.8%	29.5%
	0.00						
ihme_ayem	**-0.14*****	**América**	**44.9%**	**39.8%**	**43.4%**	**36.3%**	**29.3%**
	0.02	Am. do N e Central	46.8%	40.9%	45.6%	36.8%	30.3%
lgsg	**-0.60*****	Am. do Sul	41.1%	o	38.9%	35.2%	27.3%
	0.06						
lopenk	**0.21*****	**Europa**	**25.2%**	**23.9%**	**26.4%**	**21.4%**	**22.8%**
	0.05	Europa Ocidental	17.8%	16.0%	17.3%	13.3%	13.0%
lisg	0.09	Eur. Orien. e URSS	**36.2%**	35.5%	37.7%	32.5%	32.8%
	0.06						
lcsg	**0.43*****	Ásia	45.7%	43.1%	43.3%	41.5%	30.6%
	0.09	Extremo Oriente	44.9%	42.9%	41.7%	40.0%	22.2%
tend	**0.06*****	Asia do Sul	45.4%	43.9%	46.4%	43.8%	36.7%
	0.01	Sudeste Asiático	46.4%	42.3%	40.7%	40.0%	29.2%
global	-0.02						
	0.12	**Oceania**	**67.0%**	**63.8%**	68.2%	60.8%	61.8%
llong	0.09						
	0.10	**Total**	**45.8%**	**42.3%**	**44.2%**	**38.2%**	**33.1%**
con1	**-1.53*****						
	0.16	N	7617	3233	1727	849	544

M. Logístico	Painel Anual	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
con2	**-0.75*** **						
	0.17						
con3	-0.29						
	0.26						
con4	**-1.08*** **						
	0.17						
cons	0.98						
	0.70						
N	6325						
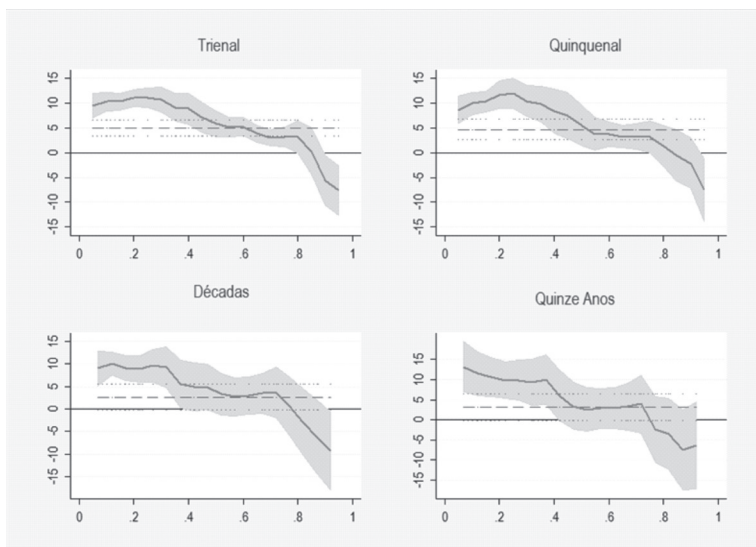
Figura 2 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica em diferentes intervalos temporais - efeitos fixos continentais[108]

Fonte: CGV e UTIP-EHII

[108] No modelo com dados trienais foram selecionadas todas as cinco variáveis. Nos outros três modelos - com dados quinquenais, por décadas e com intervalos de 15 anos, excluímos apenas **difmundo**, pois nestas especificações esta variável não está associada com democracia.

O formato da curva é bem semelhante em todos os gráficos, independente do intervalo de tempo considerado. De fato os efeitos os efeitos da democracia sobre a desigualdade são mais fortes no sentido de reduzir a desigualdade econômica nas sociedades muito desiguais, sendo, por outro lado, positivos nas sociedades mais iguais. Além disso, nos quatro modelos apresentados na Figura 2 existe um efeito positivo e relativamente homogêneo da desigualdade nos primeiros quatro decis da distribuição de desigualdade, com uma magnitude do efeito semelhante e em torno de 10 pontos de GINI. Isto é a democracia tende a fomentar a desigualdade econômica nos casos mais iguais da amostra.

Entre o 3º e 4º decil este efeito positivo da democracia sobre a desigualdade econômica começa a ser amenizado até que por volta do 8º decil a curva dos efeitos heterogêneos ultrapassa a linha preta contínua, que indica o valor nulo, e os efeitos passam a ser negativos. É somente nos últimos dois decis da distribuição que a democracia produz de fato um efeito negativo sobre a desigualdade e próximo ao 9º decil o efeito passa a ser máximo, atingindo uma magnitude de -10 pontos negativos. A única ressalva é que no gráfico inferior direito, cujos intervalos são de 15 anos, os erros padrões são bastante grandes e não temos completa confiança estatística no dado estimado. Por outro lado, parece claro que os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade são uma especificidade das sociedades mais desiguais, corroborando os achados empíricos anteriores e a hipótese da heterogeneidade dos efeitos.

Ao longo do capítulo entramos na discussão bastante complexa a respeito dos efeitos heterogêneos da democracia

sobre a desigualdade econômica. Para tal, nos dedicamos, na primeira parte, à análise da adequabilidade do método de variável instrumental para resolver os problemas da potencial causalidade reversa existente na relação entre democracia e desigualdade. Definimos esse problema como potencial, pois existem estudos na literatura que apontam para efeitos completamente diferentes da desigualdade sobre a democracia. Enquanto Acemoglu e Robinson (2006) e Boix (2003) chamam atenção à ameaça redistributiva que a democracia representa às classes dominantes, ao empoderar os desfavorecidos, Ansell e Samuels (2010 e 2014) entendem a chave da democratização como a busca por proteção aos direitos de propriedade de novas elites contra os poderes de um líder autoritário ou de um estado opressor e absolutista.

A seguir demonstramos que as variáveis de difusão e de longitude são instrumentos adequados, pois atendem aos dois critérios básicos para a validade da estimação por variável instrumental: (a) são correlacionados com democracia; e (b) não possuem um efeito causal sobre desigualdade independente dos efeitos da própria democracia. Postas tais condições, podemos assumir com razoável cautela que a associação entre a variação nos instrumentos e a variação em desigualdade deve, de fato, ser atribuída aos próprios efeitos da democracia sobre a desigualdade. E assim temos confiança estatística para estimar os efeitos da democracia livres da influência que a própria desigualdade exerce sobre os regimes políticos.

Para encontrar evidências empíricas em relação ao primeiro critério foram realizados séries de testes estatísticos em cada uma das especificações e só foram aceitas as variáveis instrumentais que apresentaram bons resultados em todos. Desta forma, temos razoável grau de certeza que o conjunto de

instrumentos propostos nesta pesquisa identificam fortemente democracia, evitando os graves problemas decorrentes do uso de instrumentos fracos.

Por outro lado, não existem testes adequados para testar o requisito fundamental imposto pela hipótese de restrição de exclusão. Contudo, além da argumentação de que não há nenhum mecanismo que conecte a longitude de um país com o seu nível de desigualdade interno, assim como a própria difusão de democracia, realizamos alguns testes de Wald que são possíveis de serem realizados em modelos sobreidentificados. E isso foi possível, pois em todas as especificações sobreidentificamos a variável endógena democracia.

Após este longo exercício de identificação, introduzimos uma série de diferentes especificações e análises da relação entre democracia e desigualdade, além de inclusive termos apresentados modelos que estimam essa relação em bancos de dados com cortes temporais mais amplos (Figura 2). A série de gráficos apresentada deixa claro que a relação entre democracia e desigualdade não deve em hipótese alguma ser reduzida a um efeito homogêneo. Há evidências fortíssimas de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade variam de acordo com o contexto socioeconômico no qual a competição política ocorre.

Ademais, com exceção apenas do gráfico 17, que estima a relação entre democracia e desigualdade sem incluir nenhum efeito fixo, a variação dos efeitos da democracia parece não ser monotonicamente variada ao longo da distribuição de desigualdade. Em boa parte das estimações, foi indicado um efeito positivo da democracia sobre a desigualdade nas sociedades mais iguais que tendia a ser estável ao longo dos primeiros dois ou quatro decis da distribuição. E apenas quando a democracia ocorre em níveis intermediários de desigualdade,

esses efeitos positivos começavam a ser minimizados até que nos últimos quatro decis da desigualdade se tornavam negativos e seu ponto de maior contundência se localizava entre os dois ou mesmo no último decil da distribuição.

Assim, retomando as duas hipóteses apresentadas no capítulo 2:

> **H1:** *As democracias possuem em média um efeito negativo sobre a desigualdade.*
>
> **H2:** *Os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade são maiores nas sociedades mais desiguais e tendem a ser menos relevantes em sociedades mais iguais.*

Podemos concluir que a Hipótese 2 encontra forte respaldo nos dados. Parece não restar dúvidas que os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica tendem a ser negativos nas sociedades mais desiguais do que nas sociedades iguais, onde de fato, encontramos evidências robustas que os efeitos são positivos. Isto é, a democratização de uma sociedade igual leva a um posterior crescimento da desigualdade operado pelo próprio sistema político.

Por outro lado, em relação à Hipótese 1, dada a existência destes efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade que atravessam o eixo dos efeitos nulos, não está claro qual é o efeito médio da democracia sobre desigualdade. Em todos os gráficos analisados incluímos uma linha que indica a magnitude e os erros padrões dos efeitos médios. Em algumas das especificações, como, por exemplo, aquelas com efeitos fixos continentais, o efeito médio da democracia sobre a desigualdade é positivo. Já em outra, a especificação com efeitos fixos continentais e temporais, o efeito médio é nulo, sendo

equilibrado pelos efeitos negativos em sociedades desiguais e os efeitos positivos em sociedade iguais. E ainda, outras especificações, como a sem nenhum tipo de efeito fixo ou inclusive outras com efeitos regionais e temporais, o efeito médio da democracia foi negativo.

Esta inconsistência dos achados sobre o efeito médio da democracia sobre desigualdade resulta do fato que a suposição da homogeneidade dos efeitos é extremamente equivocada. É de fundamental importância teórica e empírica a contextualização dos efeitos da democracia sobre a desigualdade de acordo com as condições socioeconômicas nas quais os partidos políticos competem pelo voto popular, incluindo como calculam o custo benefício da obtenção do apoio político eleitoral dos segmentos mais desfavorecidos da sociedade e a existência ou não de uma demanda por redistribuição pela cidadania.

Diante deste rol de evidências, concluímos que os efeitos da democracia são heterogêneos e que nas sociedades mais desiguais é de fato um regime político que reduz com contundência a desigualdade econômica entre os cidadãos. Por outro lado, o arcabouço teórico desenvolvido no capítulo 2 não fornece todas as pistas para explicar o achado empírico que em sociedades mais igualitárias a democracia tende a aumentar a desigualdade econômica, ainda que, historicamente, os efeitos estejam relacionados a transição política nos antigos países sob a esfera de influência da URSS e a democratização destas sociedades tenha sido concomitante ao esforço de diferenciação dos indivíduos com o fim da organização da vida econômica via planejamento central. A ausência de uma clivagem redistributiva implicaria de maneira mais imediata em um não efeito da democracia sobre a desigualdade, mas o que encontramos de maneira consistente ao longo dos diversos modelos foi um efeito positivo da democracia. Desta maneira, parece

existir a partir dos dados analisados um mecanismo por meio do qual a competição política produz mais desigualdade que as ditaduras em sociedades mais igualitárias.

Finalmente, devido ao fato que existem algumas polêmicas e discussões a respeito das diferentes maneiras de se mensurar democracia e desigualdade, no próximo capítulo testamos a robustez destes achados, analisando a relação entre democracia e desigualdade em outros bancos de dados que cobrem o mesmo horizonte temporal e em um horizonte histórico que abrange todo o processo de democratização do mundo desenvolvido e em desenvolvimento, ainda que o custo da maior abrangência temporal seja a própria qualidade dos dados.

Testando a relação em outros dados

O objetivo principal deste quinto capítulo é aprofundar a consistência dos achados anteriormente apresentados e tornar mais latente a veracidade da hipótese de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são heterogêneos e de que a democracia é um contundente agente redutor da desigualdade econômica em sociedades mais desiguais. Para tal empreitada o dividimos em quatro seções.

Nas duas primeiras analisamos outras mensurações de desigualdade e democracia para o período pós 2ª Guerra Mundial. Na primeira analisamos se os resultados permanecem se mudarmos a medida de democracia para a escala elaborada pelo POLITY IV. Na segunda analisamos as três outras medidas de desigualdade propostas no capítulo 3, SWIID, SIID e Capshares. Na terceira seção analisamos a relação da democracia e desigualdade em um horizonte histórico mais extenso, utilizando dados que mensuram as duas variáveis desde o século XIX.

Na quarta seção verificamos se os efeitos da democracia são localizados no tempo ou se estendem ao longo da experiência democrática, tal como alguns autores como Muller (1988) e Sirowy e Inkeles (1990) entendem que po-

dem funcionar os mecanismos causais da democracia sobre a desigualdade. Para tal discussão fazemos uma pequena alteração na variável independente. A medida deixa de ser se um simples indicador se o país possui um regime democrático ou não e passa a ser uma medida da persistência do regime, calculada por meio da contagem de anos passados desde a transição democrática.

5.1 Polity IV

Conforme exposto no capítulo 3, existe um debate sobre como o fenômeno da democracia deve ser mensurado empiricamente e em quais dimensões de um regime político estão suas propriedades essenciais. Optamos como medida principal a proposta dicotômica de Cheibub, Gandhi e Vreeland (2010). Entretanto, existem outras duas medidas de regime político usualmente utilizadas na literatura e entre elas destacamos o projeto do POLITY IV que mensura diversas características dos regimes políticos (MARSHALL et al., 2002).

No próprio capítulo 3, após apresentarmos brevemente o formato policotômico da medida do POLITY IV, propusemos três novas formas de mensuração da competição política de um determinado país baseadas em duas escalas do POLITY IV: a) **Participação:** classificação dicotômica na qual os regimes políticos são qualificados como tendo participação política competitiva (democráticos) ou não competitiva (autoritários); b) **Recrutamento:** classificação dicotômica na qual o método de recrutamento eleitoral dos chefes do Executivo é considerado como democrático e todos os outros são considerados como autoritários; e, por fim, c) **Competição:** a interação entre

as duas variáveis, sendo considerados democráticos apenas os regimes com participação política competitiva e recrutamento do Executivo pela via eleitoral.

Embora aparentemente a variável do CGV e estas transformações das variáveis do POLITY mensurem uma mesma dimensão do fenômeno político democrático, as correlações entre as três medidas não são tão elevadas quanto o esperado. A correlação entre Participação e o CGV é de apenas 0.58. Dos 6418 regimes analisados pelas duas escalas concomitantemente, em 38 casos a classificação POLITY IV analisa a participação como competitiva e CGV define o regime como ditatorial. E 1351 casos analisados como democráticos pelo CGV são considerados como regimes cuja participação não é competitiva pelo POLITY IV. Fica claro que a variável natureza competitiva da participação política do POLITY IV é mais conservadora e exigente que a definição minimalista assumida pelo CGV.

Já a correlação entre Recrutamento e o CGV é maior, próxima de 0.79. Dos 6418 casos analisados concomitantemente existe desacordo em 663. Destes, 232 são classificados como ditaduras pelo CGV e como recrutamento eleitoral pelo POLITY IV e 431 democracias do CGV não possuem um critério de recrutamento considerado como eleitoral pelo POLITY IV. Por fim, a nova medida de Competição que utiliza os dois requisitos acima se aproxima muito da variável Participação, pois apenas em 8 casos o POLITY IV classificou um mesmo caso como tendo participação política competitiva e método de recrutamento do Executivo não eleitoral[109]. Posto

---

[109] Taiwan (1992 a 1995) e Uruguai (1985 a 1988). O primeiro é classificado como ditadura pelo CGV e o segundo como democracia. A correlação entre as variáveis Participação e Competição é de 0.996.

isto, devido a esta enorme convergência entre Participação e Competição, testaremos a hipótese dos efeitos heterogêneos apenas para a segunda, que é justamente a que agrega as duas medidas de Participação e Recrutamento.

Tabela 13 – Estatística descritiva dos dados de participação e recrutamento

1 – Correlações (1963 – 2008)			
	CGV	**Participação**	**Recrutamento**
Participação	0.578		
Recrutamento	0.785	0.642	
Competição	0.579	0.996	0.646
2 - Tabelas de Contingência: POLITY e CGV (1963 – 2008)			
CGV = 0		**Recrutamento**	
Participação	0	1	Total
0	3572	198	3770
1	4	34	38
Total	3576	232	3808
CGV = 1		**Recrutamento**	
Participação	0	1	Total
0	427	924	1351
1	4	1255	1259
Total	431	2179	2610
		CGV	
Competição	0	1	Total
0	3774	1355	5129
1	34	1255	1289
Total	3808	2610	6418

Observação: A diferença do total desta tabela (6418) para o total da Tabela 12 (7617) decorre do fato que o Polity IV cria mais valores faltantes do que o CGV.

Na Tabela 13 apresentamos a descrição de cada uma dessas três novas variáveis. E mostramos como elas estão fortemente relacionadas entre si e são uma definição mais conservadora do que seja um regime político democrático do que o CGV. Podemos observar nesta tabela que o CGV categoriza 3808 casos como ditaduras e 2610 como democracias. Enquanto isso, a variável Recrutamento observa 2411 (2179 + 232) casos de democracia e 4007 (3576 + 431) de ditaduras. Já a variável Participação observa apenas 1297 (1259 + 38) países-anos democráticos e 5121 (3770 + 1351) ditatoriais. Por fim, a variável mais restritiva, Competição, observa 1289 anos democráticos e 5129 anos ditatoriais.
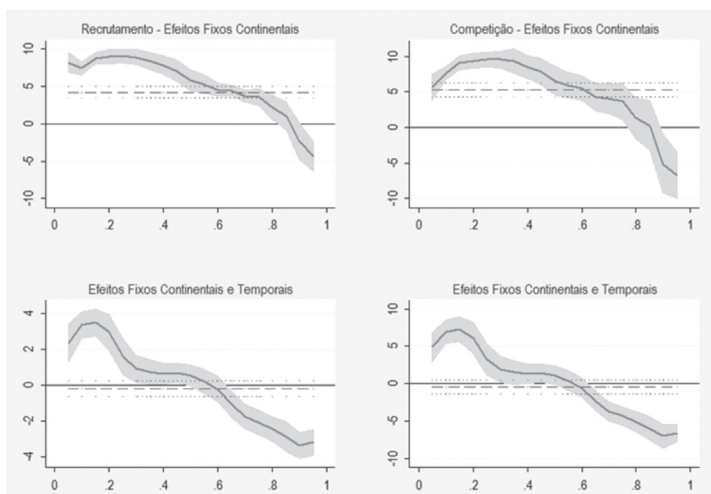
Figura 3 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica – POLITY IV [110]
Fonte: POLITY IV e UTIP-EHII

[110] Os modelos que mensuram democracia com a variável recrutamento tem como instrumentos de identificação difmundo, difregião, llong e horiental quando a especificação contém apenas efeitos fixos e quando são adicionadas as dummies de anos apenas difmundo identifica o modelo. Já na mensuração

Discutido o formato das 3 novas variáveis, na Figura 3 apresentamos os efeitos da democracia sobre a desigualdade ao longo da distribuição da variável dependente. Como método de identificação, utilizamos os dois conjuntos de instrumentos de difusão e de longitude. Mais uma vez, incluímos dentre os cinco apenas aqueles que atendem aos critérios necessários para a validade da estimação por variável instrumental. A especificação básica dos modelos da metade superior da figura tem efeitos fixos continentais. Já a especificação da metade inferior apresenta efeitos fixos continentais e temporais. Para cada um dos modelos fizemos os testes para escolher o melhor rol de variáveis instrumentais para a identificação de democracia. Na coluna da esquerda testamos a hipótese dos efeitos heterogêneos para a variável Recrutamento. E na coluna da direita a variável mais conservadora de Competição.

O padrão da Figura 3, mais uma vez, é bem semelhante ao formato das curvas encontradas nos modelos apresentados no capítulo anterior. Encontramos um efeito positivo e homogêneo no início da distribuição de desigualdade, que vai do 1º ao 4º decil nas especificações que apenas contam com efeitos fixos continentais e do 1º e 2º decil nas especificações com efeitos fixos continentais e dummies de ano. Após este primeiro estágio, os efeitos positivos da democracia passam a ser amenizados e próximo ao 8º decil nos dois primeiros modelos ou próximo ao 6º decil nos dois modelos inferiores os efeitos da democracia tornam-se negativos. Em todos os modelos o efeito mais contundente e negativo da democracia em relação à desigualdade econômica é encontrado entre o 9º decil e o 95º centil da distribuição. Os resultados são basicamente os

---

de democracia pela variável competição, no modelo com apenas efeitos fixos continentais os instrumentos são difcont e difregião e após a adição de dummies de ano apenas difmundo identifica a variável endógena.

mesmos dos encontrados anteriormente, não importando, assim, a medida de democracia utilizada.

Um último aspecto importante de ser destacado decorre do fato que apenas observando os resultados destes quatro modelos fica clara a inconsistência da análise dos efeitos da democracia por meio da estimação dos seus efeitos médios por MQO. Enquanto nos modelos com efeitos fixos continentais a democracia tem um efeito médio positivo, nos modelos que incluem efeitos fixos para os anos, as democracias passam a ter um efeito nulo. Fica patente, outra vez, a conclusão que o suposto sobre os efeitos homogêneos da democracia é sobremaneira equivocado e uma das razões que dificultam o avanço da literatura.

Por fim, testamos os mesmos modelos incorporando efeitos fixos regionais e efeitos fixos regionais e choques temporais. Os resultados são semelhantes aos encontrados até aqui, ainda que para o modelo com efeitos fixos regionais e democracia mensurada pela variável competição não tenha sido encontrado nenhuma variável instrumental que torne a estimação válida.

5.2 Outras medidas de desigualdade

Do mesmo modo que existe um vigoroso debate sobre como o fenômeno da democracia deve ser mensurado empiricamente, também discutimos as divergências da literatura sobre quais são as melhores formas de medir a desigualdade econômica. Apresentamos três diferentes medidas de desigualdade econômica que possuem dados disponíveis para um longo período de anos e para muitos países. As duas primeiras são o *Standardized Income Inequality Data* (SIID) e a *Standardized World Income Inequality Database* (SWIID), que mensuram o mesmo conceito tratado pelo EHII: o

coeficiente de GINI. E a terceira, C*apital Shares,* captura o quanto os recursos de um determinado país são controlados pelos detentores do capital.

Esperamos encontrar relações semelhantes para diferentes mensurações do GINI, uma vez que o conceito é o mesmo: a curva de Lorenz; e a fonte primária dos dados é a compilação de surveys de GINI feita pelo UNU-WIDER. Por sua vez, em relação à terceira medida, que foi utilizada por Houle (2009) para analisar a relação entre desigualdade e processos de democratização, as expectativas são mais incertas. A variável captura outro aspecto da desigualdade: a divisão de recursos entre os detentores do capital e o resto da sociedade e não apenas a desigualdade no fluxo de renda entre os indivíduos. E a relação negativa entre democracia e desigualdade encontrada na cauda direita da distribuição de desigualdade medida pelo coeficiente de GINI não necessariamente significa, por exemplo, que os recursos utilizados pelo governo democrático para reduzir a desigualdade de renda sejam extraídos do capital. É bem possível que outros grupos da sociedade arquem com os custos de projetos e políticas públicas que almejem reduzir a desigualdade econômica.

Na Figura 4 apresentamos os efeitos da democracia, novamente mensurada pelo CGV, sobre a desigualdade econômica mensurada pelo SIID. Mais uma vez repetimos o mesmo método de identificação de democracia, utilizando os mesmos testes para identificação e verificação da hipótese de restrição de exclusão. Nesta análise temos três divergências em relação aos outros achados. Como a amostra de países analisadas pelo SIID é menos abrangente que as amostras de EHII e do SWIID[111], os primeiros passos das equações apresentaram resultados um pouco distintos. Para os dados de SIID, nenhum

[111] Enquanto o EHII possui 4138 países-anos com atribuição de valores para desigualdade e democracia, o SWIID possui mais de 4700 países-anos e o SIID apenas 2302 – menos que a metade que o SWIID.

instrumento é adequado para identificar corretamente as especificações sem nenhum efeito fixo e com apenas efeito fixo continental, enquanto tal identificação foi possível nos modelos de EHII e de SWIID. Além disso, apenas para os dados de SIID conseguimos estimar adequadamente a especificação de efeitos fixos regionais, enquanto o contrário aconteceu nas estimações de EHII e SWIID. Assim, para SIID temos poder estatístico para identificar as especificações com efeitos fixos continentais e temporais e as duas com efeitos fixos regionais (com e sem dummies de ano).

Efeitos Fixos Continentais e Temporais

Efeitos Fixos Regionais e Temporais

Efeitos Fixos Regionais
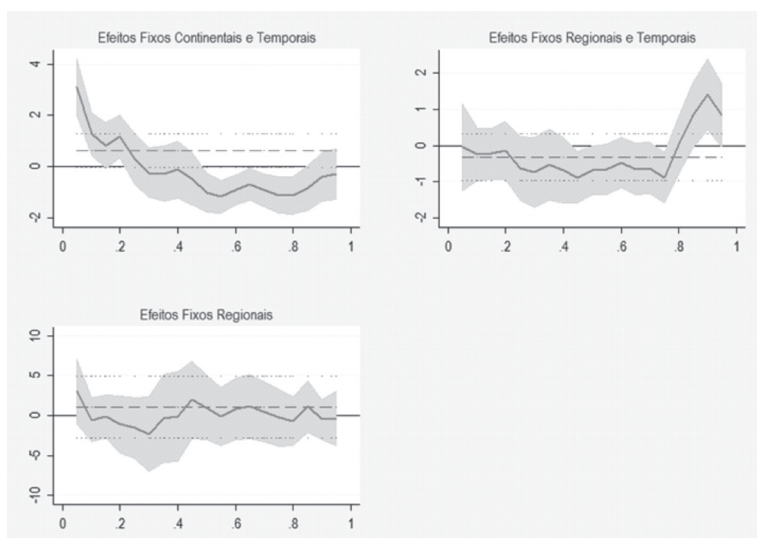
Figura 4 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - Standardized Income Inequality Data (SIID)[112]
Fonte: CGV e SIID

[112] O modelo com efeitos fixos continentais e temporais foi identificado pelos instrumentos difmundo, difcont, horiental e llong. Já o modelo com efeitos fixos regionais foi identificado por difmundo e o modelo com efeitos fixos regionais e temporais foi identificado por difmundo, difcont, horiental e llong.

Os gráficos da Figura 4 apresentam um cenário completamente diferente do encontrado até agora. Em dois dos três gráficos parece que o suposto da homogeneidade dos efeitos da democracia sobre a desigualdade encontra respaldo empírico. Além de serem homogêneos, também é indicado que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são nulos, pois as duas curvas – a de efeitos heterogêneos e de efeitos homogêneos – contêm em seus respectivos intervalos de confiança o eixo de referência dos efeitos nulos.

Na especificação com efeito fixo regional esse resultado é claríssimo. Em todos os decis da distribuição de desigualdade, a curva de efeitos heterogêneos está contida dentro do intervalo de confiança da reta de efeitos homogêneos, enquanto ambas incluem dentro de seus intervalos de confiança o eixo de efeitos nulos. O mesmo acontece na especificação com efeitos fixos regionais e temporais, com exceção apenas do último decil, onde há um efeito positivo da democracia na desigualdade. Em todos os outros decis, do 0.1 ao 0.8, o efeito é homogêneo e nulo. Por fim, na especificação com efeitos fixos continentais e temporais, os resultados recuperam, ainda que de maneira tímida, o aspecto encontrado anteriormente. Há um efeito positivo da democracia sobre a desigualdade nas sociedades mais iguais e a partir do 4º decil este efeito é negativo, embora seja relativamente homogêneo até o 95º centil.

A partir dos dados exposto nos gráficos acima, duas possibilidades empíricas emergem para explicar as brutais diferenças encontradas. Como os dados de desigualdade do SIID abrangem um menor conjunto de países, é possível que as discrepâncias sejam resultados não das diferentes técnicas de mensuração de Babones e Alvarez-Rivadulla (2007), mas

sim meramente uma questão amostral[113]. Para isso, realizamos dois exercícios: re-estimamos os resultados anteriores de EHII apenas com os casos para os quais o SIID tem dados e em segundo lugar avaliamos um terceiro banco de dados, o SWIID, que possui mais informações e cuja técnica de estimação é semelhante às adotadas por Babones e Alvarez-Rivadulla (2007).

Para utilizarmos os dados de EHII nos mesmos casos de SIID, optamos por não avaliar o primeiro passo da equação e aceitar os instrumentos que identificaram democracia nos 3 modelos da Figura 4. O total de dados analisados nesta estimação é menor, pois não há dados de EHII em 396 países-anos para os quais as informações de SIID estão disponíveis. O resultado que emerge é claríssimo: na estimação com efeitos fixo continentais, os resultados são convergentes com as evidências apresentadas no capítulo 4. Os efeitos heterogêneos da democracia variam da forma esperada: efeitos positivos da democracia entre os países mais desiguais e efeitos negativos entre os países mais desiguais, sendo o ponto de maior contundência negativa dos efeitos da democracia encontrado justamente entre o 8º e 9º decil. Retornando nossa atenção à Figura 4, a estimação de SIID com efeitos fixos continentais é entre as três apresentadas a que mais se aproxima dos achados anteriores.

Já em ambas as especificações com efeitos fixos regionais (com efeitos fixos temporais ou não), o formato da curva de efeitos heterogêneos estimada com os dados de EHII apenas para os casos onde a informação de SIID não é faltante se

---

[113] Contando com a perda de casos por dados faltantes nas variáveis controles, a estimação com SIID usa ao todo 2101 países-anos para estimar os efeitos da democracia, enquanto os modelos com EHII utilizam-se de 3781 casos e os modelos que serão analisados a seguir com os dados de SWIID possuem 4267 países-anos.

aproxima muito das duas curvas da própria Figura 4, indicando que democracia teria um efeito homogêneo e nulo sobre desigualdade. Posto isto, podemos concluir que os efeitos distintos encontrados na Figura 4 decorrem de uma questão predominantemente amostral do que das próprias discrepâncias metodológicas entre as técnicas de padronização dos dados de GINI. Isto coloca em destaque a importância da ampliação do escopo geográfico dos bancos de dados sobre desigualdade e da necessidade de incorporação de informações a respeito da dinâmica da evolução da desigualdade econômica nos países em desenvolvimento para a realização de uma análise mais acurada do fenômeno. O foco excessivo nas economias mais desenvolvidas tem um enorme potencial em enviesar a análise empírica.

Prosseguindo à verificação da robustez dos achados sobre os efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica, na Figura 5 apresentamos a estimação desses efeitos a partir dos dados de GINI sobre a desigualdade econômica bruta do SWIID, que inclusive é mais abrangente que o próprio projeto da UTIP-EHII. O mesmo método de identificação foi utilizado. Nenhum instrumento identificou corretamente as especificações com efeito fixo regional. A especificação sem efeito fixo é identificada apenas por difusão regional, a especificação com efeito fixo continental é identificada por difusão regional e continental, enquanto as duas especificações com efeitos fixos temporais – efeitos fixos continentais ou regionais – são identificadas por difusão regional e mundial.

Sem Efeito Fixo

Efeitos Fixos Continentais

Efeitos Fixos Regionais e Temporais

Efeitos Fixos Continentais e Temporais
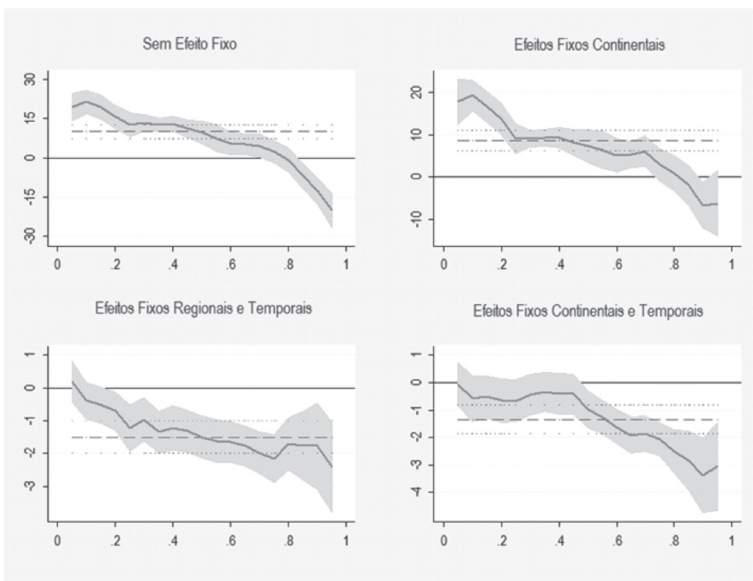
Figura 5 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - Standardized World Income Inequality Data (SWIID) para renda bruta[114]
Fonte: CGV e SWIID

Como podemos observar na Figura 5, os formatos das curvas sobre os efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade permanecem bastante semelhantes aos resultados encontrados no capítulo anterior. Os efeitos positivos da democracia sobre a desigualdade são mais fortes no início (esquerda) da distribuição de desigualdade e os efeitos são abrandados com o movimento crescente no eixo horizontal da distribuição de desigualdade. O que se destaca nas curvas da

[114] O modelo sem efeito fixo é identificado apenas por difusão regional. Já a especificação com efeito fixo continental é identificada por difregiao e difcont e as duas especificações com efeitos fixos temporais são identificadas por difmundo e difregião.

metade superior do gráfico, que não apresentam efeitos fixos ou só incluem efeitos fixos continentais, é o desaparecimento dos efeitos positivos homogêneos no início da distribuição. Há uma clara matização monotônica dos efeitos positivos da desigualdade do 1º decil da distribuição até que no 8º decil se tornam negativos ao cruzar o limiar dos efeitos nulos. Já os gráficos da metade inferior da figura indicam que os efeitos da democracia sobre a desigualdade nunca são positivos. São nulos no início da distribuição e tornam-se gradativamente mais negativos com o avanço no eixo horizontal em direção à direita da distribuição de desigualdade. E nos quatro gráficos os efeitos negativos mais contundentes da democracia sobre a desigualdade encontram-se no final da distribuição, isto é no decil dos países-anos mais desiguais da amostra.

Mais uma vez fica evidente que a estimação dos efeitos médios da democracia sobre a desigualdade a partir do suposto de sua homogeneidade é equivocada e inconsistente. Enquanto na estimação sem efeitos fixos e com efeitos fixo continentais os resultados são significantes e positivos, na estimação com efeitos fixos regionais e temporais e com efeitos fixos continentais e temporais os resultados são sempre negativos e significantes. Estes resultados estão representados pela linha tracejada horizontal.

Resultados bastante semelhantes aos apresentados na Figura 5 são obtidos se estimarmos os efeitos da democracia sobre a desigualdade a partir da desigualdade de renda líquida do SWIID. A especificação sem efeitos fixos tem o mesmo formato, com a única diferença que a amplitude dos efeitos é menor, variando entre +10 no início da distribuição e -10 no final. O mesmo padrão também se repete na especificação com efeitos fixos continentais, com exceção do fato que os efeitos

tornam-se negativos no 6º decil e não no 8º. Por fim, as curvas da metade inferior da figura são também semelhantes, com exceção apenas do fato que elas recuperam o formato tradicional, no qual os efeitos são positivos no início da distribuição, tornam-se negativos entre o 2º e o 4º decil e os efeitos mais negativos e contundentes são encontrados no 9º decil.

Posto isto, podemos concluir que a principal diferença encontrada entre os modelos que analisam o efeito da democracia sobre a desigualdade econômica mensurada pela renda líquida do efeito da democracia sobre a desigualdade de renda bruta é apenas uma questão de magnitude desses efeitos, que são um pouco menores no primeiro. Tal resultado é esperado uma vez que a desigualdade da renda líquida tende a ser menor do que a desigualdade por renda bruta, caso os países adotem um sistema tributário minimamente regressivo.

Fora isso, ao compararmos os resultados das estimações com diferentes tipos de renda, vemos que os formatos são razoavelmente semelhantes, apontando mais uma vez que a diferenciação que a literatura faz sobre estes dois tipos de desigualdade não é convincente teórico e empiricamente. Isto porque, tal como posto por Bergh (2005), os sistemas de taxação e transferência e as políticas públicas redistributivas têm efeito tanto sobre a renda líquida do presente quanto sobre a oferta de trabalho no futuro, impactando, portanto, nos formatos das distribuições líquida e bruta dos ganhos.

Finalmente, na Figura 6 apresentamos os gráficos dos efeitos heterogêneos da democracia sobre a distribuição dos recursos entre o capital e trabalho, variável com a qual Houle (2009) analisa a relação entre democracia e desigualdade. Os resultados são bastante diferentes dos encontrados no restante da pesquisa, o que parece indicar o fato que a fração do valor

agregado pertencente ao capital não é uma boa proxy para medir a desigualdade econômica entre os indivíduos. A primeira constatação que merece ser destacada é que independente do quantil analisado, o efeito da democracia sobre a fração do PIB pertencente ao capital é negativa. Isto é, a democracia sempre e de forma homogênea aumenta a participação do trabalho no processo de agregação de valor. Podemos concluir que esse efeito é homogêneo, uma vez que boa parte das curvas de efeitos heterogêneos está contida dentro do intervalo de confiança da curva de efeito médio.

Destarte, no que se refere à análise da relação entre democracia e a participação do capital na agregação do valor, podemos realmente assumir a hipótese de que seus efeitos são homogêneos e, portanto, independente do contexto socioeconômico no qual a competição política ocorre. Além do mais, é importante ter em mente que independentemente da quantidade de recursos pertencentes ao trabalho ou ao capital, isto não quer dizer diretamente que estes recursos são distribuídos concentrada ou homogeneamente entre os trabalhadores e, consequentemente, os países nos quais o valor agregado é mais concentrado no trabalho (lado esquerdo dos gráficos) ou no capital (lado direito) não necessariamente possuem maior ou menor desigualdade econômica.

Fica claro, por outro lado, que a democracia impacta positivamente a participação do trabalho no valor adicionado de uma dada economia, mas este impacto não é condicionado em relação ao nível de concentração da renda no capital. Enquanto nas análises feitas pelas diferentes mensurações do GINI, fica evidente que quanto maior for a desigualdade de renda entre os indivíduos, maior será o efeito da democracia na sua redução. Conectando os dois resultados e assumindo o

pressuposto que o capital é concentrado na mão de alguns indivíduos, que conformariam a elite econômica, podemos concluir que a democracia reduz a desigualdade nas sociedades mais desiguais, mas isto não afeta a fração do valor adicionado que está concentrado no capital, além do impacto geral que a democracia tem em proteger o papel do trabalho no processo de agregação de valor.
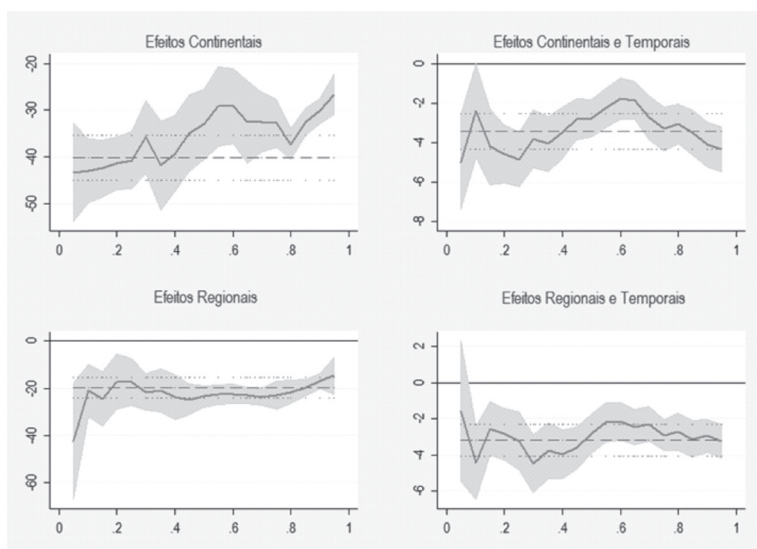
Figura 6 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a participação do capital na agregação de valor[115]
Fonte: CGV e Houle (2009)

[115] Não identificamos adequadamente democracia na especificação sem nenhum efeito fixo e só conseguimos aceitar a hipótese de restrição de exclusão da especificação com efeitos fixos regionais e temporais a 5% de significância. A especificação com efeito fixo continental foi identificada por difcont e difregião; já a especificação com efeito fixo continental e temporal foi identificada por difmundo e difcont; a especificação com efeito fixo regional foi identificada por difmundo e llong; e, finalmente, a especificação com efeito fixo regional e temporal é identificada por difmundo, difcont e llong.

5.3 Desigualdade e democracia desde o século XIX

Até agora os achados da relação entre democracia e desigualdade indicam que de fato os efeitos da democracia sobre a desigualdade são heterogêneos e o impacto da democracia em direção à redução das disparidades econômicas entre os indivíduos é maior nos países mais desiguais. Contudo os achados refletem apenas o que aconteceu na segunda metade do século XX. Diante disso nos questionamos se estes resultados permanecem se observamos a relação entre as duas variáveis em um horizonte histórico mais abrangente e que incorpore os processos de democratização dos primeiros regimes representativos democráticos da Europa Ocidental, América do Norte e Oceania.

Para responder a tal questionamento, iremos analisar a relação entre democracia e desigualdade em um intervalo histórico de longa duração. Com os dados já apresentados de Bourguignon e Morrison (2002) e trabalhados por Ansell e Samuels (2014), temos um banco alternativo que permite capturar os efeitos da democracia e desigualdade nesta escala histórica maior. Obviamente que a escala mais extensa dos dados não resolve o problema da relação causal inversa entre democracia e desigualdade. E para tal adotamos a mesma metodologia e os mesmos tipos de instrumentos de difusão de democracia e de posicionamento longitudinal do país para identificar a relação.

O cálculo da difusão de democracia é refeito a partir da nova mensuração de democracia que associa aditivamente três regras distintas: a) os regimes definidos como democráticos por Boix e Rosato (2001), b) os regimes políticos que ampliaram o direito de voto a 100% da população masculina adulta (PRZEWORSKI, 2009) e c) os regimes que proíbem a existência legal da escravidão em seu território.

Uma restrição empírica que adotamos nessa subseção é a não inclusão de efeitos fixos regionais. Conforme já exposto no capítulo 3, os autores dos dados de desigualdade Bourguignon e Morrison (2002) calcularam os dados de mais de 70% dos anos-países disponíveis na amostra a partir da estrutura econômica regional e não nacional. Dos 53 países para os quais temos informações sobre desigualdade e regime político, apenas para 16 temos os dados de desigualdade calculados a partir da própria unidade econômica nacional. Desta forma, a inclusão de efeitos regionais retira boa parte da variabilidade dos dados, enviesando a análise. E, consequentemente, não teríamos poder estatístico para discernir se os resultados obtidos seriam decorrentes da própria dinâmica dos dados ou do nível de agregação a partir do qual os cálculos dos GINIs de Bourguignon e Morrison (2002) foram feitos.

Além das novas medidas de desigualdade, democracia e difusão de democracia, também incluímos novos vetores de variáveis controles. Isto porque o conjunto de controles utilizados nas especificações anteriores também foi compilado apenas para a 2ª metade do século XX. Na nova especificação incluímos as seguintes três variáveis de controle: o PIB real per capita como medida do nível de desenvolvimento econômico, o nível de escolaridade da população e a desigualdade da distribuição da propriedade rural, além disso, incluímos também variáveis de tendência. Utilizamos a medida de renda per capita de Angus Maddison (1997) e as medidas de desigualdade rural e de níveis de escolaridade de Tatu Vanhanen (2000)[116].

---

[116] A medida de desigualdade rural é calculada por Ansell e Samuels a partir das medidas de agricultura familiar (*Family farms)* e do nível de urbanização da população, ambas de Tatu Vanhanen (2000). A desigualdade rural é obtida a partir da operação: (1 - agricultura familiar) * (1 - população urbana) – a proporção da

Empregamos para as três variáveis as mesmas transformações e os dados utilizados por Ansell e Samuels (2014)[117]. Na Tabela 14 apresentamos a estatística de cada uma delas.

Tabela 14 – Estatística descritiva das variáveis de controle

Variáveis	Indicador	N	Média	Mediana	Des. Pad	Fonte
Desenvol-vimento Econômico	Ln {PIB real $per\ capita_{it}$}	10354	7.70	7.62	0.91	Maddison
Desigualdade Rural	$(1-agr.f)*(1-popurb)$	9612	50.73	52.25	24.72	Vanhanen
Escolarização	½ * (alfabetização + nº estudantes)	9613	32.81	30.25	23.11	Vanhanen

Na especificação final das variáveis controles incluímos um termo quadrático para o desenvolvimento econômico, tal como fizemos nos modelos anteriores, e uma linha de tendência de ordem 3. Incluímos também uma variável dummy identificando o período entre o começo e o final das duas Grandes Guerras Mundiais que, conforme vimos no capítulo 3, é caracterizado por uma forte queda da desigualdade econômica. Além disso, como o horizonte temporal desta análise é maior, optamos por defasar democracia em três anos e difusão de democracia em seis. Desta forma, as equações estimadas são:

concentração fundiária, ponderado pelo peso rural da população. Já a medida de escolaridade é a média da porcentagem de adultos alfabetizados e do número de estudantes por habitante (ANSELL; SAMUELS, 2014).

[117] Agradecemos mais uma vez a gentileza dos professores Ben Ansell e David Samuels, por terem nos fornecido todos os dados utilizados na análise histórica da relação entre democracia e desigualdade.

1) EQUAÇÃO ESTIMADA NO PRIMEIRO PASSO:

$$L3.DEMO_{it} = \boldsymbol{\alpha}i + \boldsymbol{\beta}6\ controles_{it} + \boldsymbol{\beta}7\ L6.Instrum_{it} + \boldsymbol{\beta}8\ contin. + \boldsymbol{\beta}9\ tend + \boldsymbol{\beta}10\ tend^2 + \boldsymbol{\beta}11\ tend^{3\,+}\,\boldsymbol{\pi}_{it} \quad \text{(Eq. 5.1)}$$

2) EQUAÇÃO ESTIMADA NO SEGUNDO PASSO:

Assumindo especificação linear para o τ - *ésimo quantil*:

$$Q_\tau\,[.\,|\,X = x] = \boldsymbol{\alpha}i + \boldsymbol{\beta}1\ controles_{it} + \boldsymbol{\beta 2}\ \mathbf{L3.DEMO_{it}} + \beta3\ contin. + \boldsymbol{\beta}4\ tend + \boldsymbol{\beta}5\ tend^2 + \boldsymbol{\beta}5\ tend^3 + \boldsymbol{\varepsilon}_{it} \quad \text{(Eq. 5.2)}$$

No qual $Q_\tau\,[.\,|\,\mathbf{X} = x] \equiv \frac{inf}{q}\ P\,(\,.\le \mathbf{q}\,|\,\mathbf{X} = x) \ge \tau$ *sendo o τ -ésimo quantil condicionado na distribuição da variável dependente BM-GINI.*

Em relação à estratégia de identificação de democracia, não temos variáveis instrumentais que nos permitam identificar adequadamente a especificação sem a presença de algum efeito fixo. Isto porque embora as variáveis de difregião e difcont estejam relacionadas fortemente com democracia, ambas violam os testes de Wald da hipótese de restrição de exclusão. Já nas especificações de efeitos fixos continentais e de efeitos fixos continentais e temporais, estas mesmas duas variáveis identificam democracia e não estão relacionadas com desigualdade, qualificando-se, portanto, como instrumentos adequados.

O Gráfico 18 apresenta a relação entre democracia e desigualdade na especificação com efeitos fixos continentais. Mais uma vez, fica claro que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são fundamentalmente heterogêneos e o suposto sobre a homogeneidade dos efeitos é equivocado, mesmo quando analisamos um dado sobre GINI de maior escala histórica

abrangendo os processos de democratização da América do Norte, Oceania e Europa Ocidental. O Gráfico 18 não deixa dúvidas de que modelos lineares condicionais à média (MQO) – a reta horizontal tracejada – refletem de maneira assaz inadequada e reduzem em muito a complexidade existente na relação entre democracia e desigualdade.

Os efeitos da democracia só se tornam negativos no final da distribuição, mais especificamente nos 30% países-anos mais desiguais da amostra, justamente os países-anos nos quais é maior a probabilidade do surgimento de uma demanda por redistribuição no seio da cidadania e onde o cálculo pelos partidos do custo benefício da adoção de plataforma eleitoral e políticas públicas que foquem nesse problema tende a ser positivo. Por outro lado, no primeiro decil (onde estão os países--anos mais iguais da amostra) existe um forte efeito positivo da democracia, em torno de 10 pontos de GINI, mas que é decrescente até o 2º decil, onde os efeitos positivos se estabilizam em torno de 7 pontos. A partir do 5º decil, os efeitos voltam a ser amenizados e no 7º decil essa gradativa suavização cruza o valor zero (a linha referencial do efeito nulo) e seus efeitos tornam-se negativos.

Resumindo, a democracia aumenta a desigualdade de maneira substancial entre os países-anos mais iguais e após certo nível de desigualdade seus efeitos positivos são arrefecidos monotonicamente. Nos países-anos mais desiguais da amostra, os seus efeitos são verdadeiramente negativos, sendo que o ápice deste efeito negativo está no 9º decil, por volta de -6 pontos de GINI. E a estabilização positiva dos efeitos da democracia sobre a desigualdade não acontece nos países-anos mais igualitários, mas sim numa região mais intermediária do gráfico, entre o 2º e o 5º decil da distribuição de desigualdade entre os países.
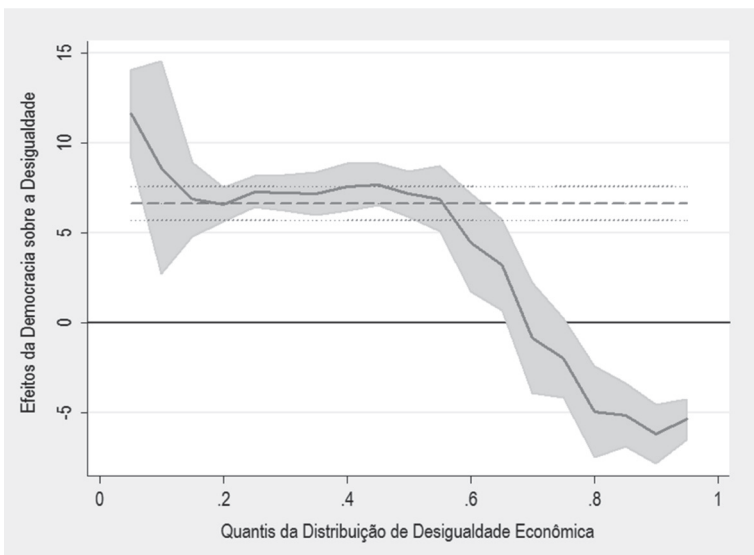
Gráfico 18 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais
Fonte: BOIX, ROSATO e BM-GINI

No Gráfico 19 repetimos a mesma estimação, mas agora usando como especificação efeitos fixos continentais e efeitos temporais para o controle de choques exógenos por meio de dummies de década. O vetor de variáveis controles e os instrumentos de identificação são os mesmos. O gráfico corrobora o resultado anterior, demonstrando que mesmo com a adição destas dummies de décadas, os efeitos da democracia sobre a desigualdade são fundamentalmente heterogêneos e a abordagem tradicional que assume efeitos homogêneos é equivocada. Ademais, o formato do gráfico é essencialmente o mesmo. Os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade surgem a partir do 7º decil da distribuição, quando a curva de efeitos heterogêneos cruza a linha de referência do efeito nulo

e o ápice dos efeitos negativos está no 9º decil, em torno de -5.5 pontos de GINI.
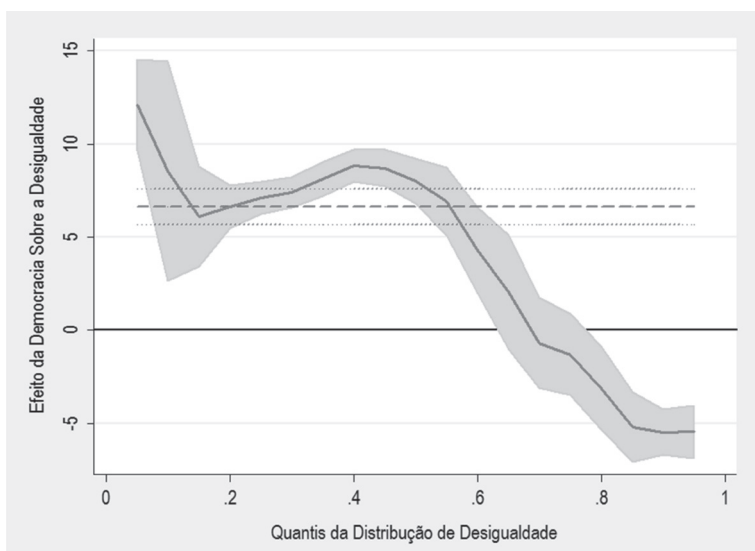
Gráfico 19 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais e temporais (décadas)
Fonte: BOIX, ROSATO e BM-GINI

No Gráfico 20 adicionamos à especificação anterior efeitos temporais com dummies de ano, o que torna a estimação mais exigente. Os vetores de variáveis controles e instrumentos permanecem idênticos. E mais uma vez o gráfico corrobora os resultados encontrados ao longo de toda a pesquisa, os efeitos da democracia sobre a desigualdade são fundamentalmente heterogêneos e a abordagem tradicional que assume efeitos homogêneos é equivocada. Ademais, o formato do gráfico é essencialmente o mesmo dos formatos encontrados nos Gráficos 18 e 19. Os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade surgem a partir do 7º decil da distribuição, quando

a curva de efeitos heterogêneos cruza a linha de referência do efeito nulo e o ápice dos efeitos negativos está no 9º decil, em torno de -5.4 pontos de GINI.
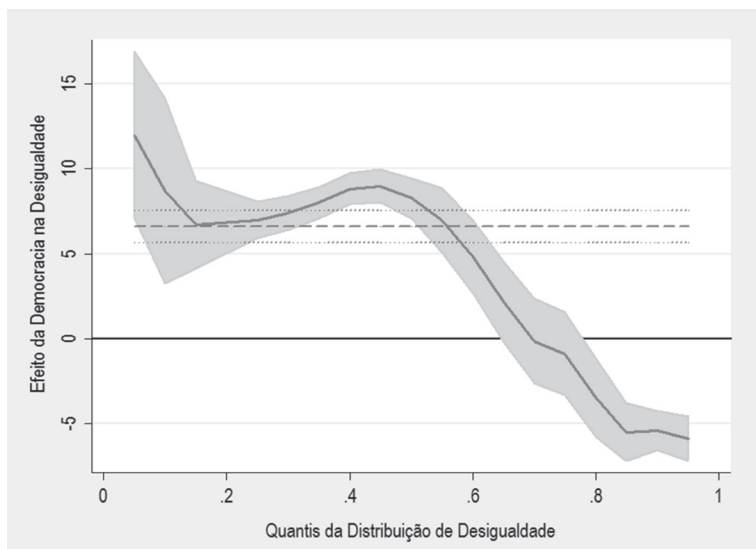
Gráfico 20 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais e temporais (anos)
Fonte: BOIX, ROSATO e BM-GINI

Outro problema de pesquisa apresentado na seção 4.2 no capítulo 4 foi a questão da existência de muitas observações faltantes nos dados de desigualdade econômica. A solução apresentada foi a utilização de intervalos temporais maiores como unidade de análise, estratégia muito utilizada na literatura sobre desigualdade. Repetimos mais uma vez essa abordagem e re-estimamos a relação entre democracia e desigualdade tendo com unidade de análise o país-década. Com esta alteração temos um novo banco de dados, agora com 53 países e 10 unidades temporais.

Nos Gráficos 21 e 22 apresentamos estes resultados. No primeiro incluímos na especificação apenas efeitos fixos continentais e no segundo efeitos fixos continentais e dummies de décadas. Como método de identificação utilizamos as mesmas regras anteriores e identificamos democracia com as variáveis de difusão regional e continental. Uma alteração na especificação foi a não inclusão de defasagens para mensurar a variável independente de democracia e a inclusão de apenas uma defasagem para mensurar os instrumentos de difusão. A escolha por não utilizarmos tantas defasagens como na estimação anterior decorre de duas ponderações: a própria extensão da unidade temporal abrangendo um longo período de 10 anos e o fato de termos poucas unidades de tempo na análise.

Efeito da Democracia na Desigualdade

30 20 10 0 -10 -20

0 .2 .4 .6 .8 1

Quantis da Distribuição de Desigualdade Econômica
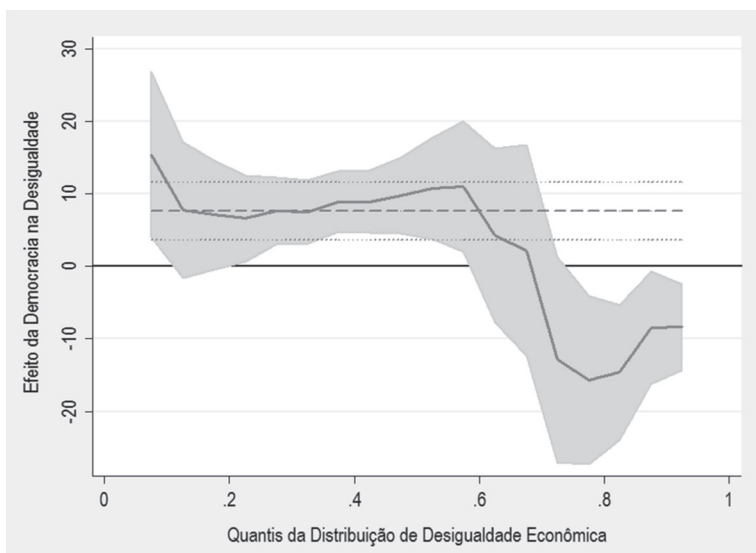
Gráfico 21 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais - países-décadas
Fonte: BOIX, ROSATO e BM-GINI

No Gráfico 21 encontramos um formato dos efeitos heterogêneos bastante semelhante com aquele encontrado na primeira especificação apresentada no Gráfico 1 (p. 197). Existem, basicamente, três momentos distintos dos efeitos da democracia sobre a desigualdade. Um longo e homogêneo efeito positivo ao longo da primeira metade da distribuição, com um efeito positivo de ser democracia ao longo dos 10 anos de cerca de 10 a 11 pontos de GINI. Após o 5º decil (ou a mediana), uma constante e monotônica amenização dos efeitos positivos da democracia sobre a desigualdade, até que um pouco antes do 7º decil a curva de efeitos heterogêneos cruza a linha de referência dos efeitos nulos e a democracia passa a ter um efeito redutor da desigualdade. No 8º decil esse efeito negativo atinge seu valor máximo, em torno de -15 pontos de GINI.
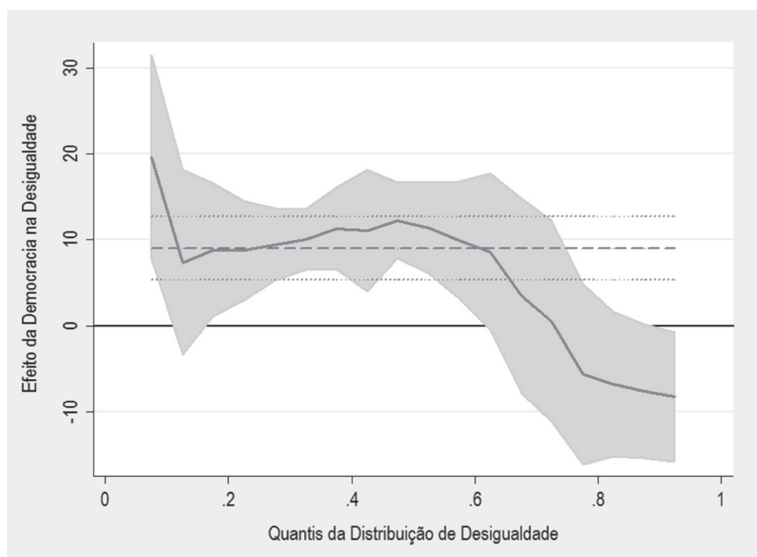
Gráfico 22 – Efeitos heterogêneos da democracia sobre a desigualdade econômica - efeitos fixos continentais e temporais - países-décadas
Fonte: BOIX, ROSATO e BM-GINI

No Gráfico 22 adicionamos à especificação anterior efeitos temporais com dummies de década. E as mesmas conclusões podem ser retiradas com a análise do Gráfico 22, com exceção apenas de o fato de que o maior efeito negativo da desigualdade não se encontra no 8º decil, mas sim na ponta da distribuição, onde os efeitos atingem por volta de -8 pontos de GINI. Permanece, portanto, a constatação que existe um efeito positivo da democracia que é relativamente constante ao longo dos primeiros cinco decis da distribuição, ainda que nos primeiros centis estimados (o 7º e 8º centil) os efeitos sejam muito mais fortes (cerca de 17 pontos de GINI), mas a seguir reduzidos para apenas 9 pontos de GINI no 1º decil, a partir do qual são mantidos relativamente dentro de um mesmo intervalo. E após os níveis intermediários de desigualdade, a democracia passa a ter seus efeitos positivos amenizados, até que estes se tornam negativos e atingem o valor negativo máximo no final da distribuição.

Posto isto, podemos retomar as três principais constatações que fizemos sobre a democracia com um vasto leque adicional de evidências empíricas que as respaldam: a saber: 1) a relação entre democracia e desigualdade não deve ser tratada como homogênea e nem seus efeitos são monotônicos ao longo da distribuição da desigualdade; 2) existe uma relativa homogeneidade dos efeitos da democracia no início da distribuição de desigualdade e só apenas quando um país/década atinge níveis intermediários de desigualdade é que a democracia passa a ter seus efeitos positivos amenizados; e, por fim, 3) apenas no final da distribuição de desigualdade que a democracia age de maneira mais contundente na redução da desigualdade, o que parece indicar um limiar básico a partir do qual a competição política democrática passa a ter como tema principal a efetiva redução da desigualdade econômica.

5.4 Persistência democrática e a desigualdade

Como último exercício empírico verificamos se os efeitos do acúmulo da experiência democrática afetam os padrões da relação entre democracia e desigualdade encontrados ao longo da pesquisa. Muller (1988), inclusive, propôs e encontrou evidências sobre o argumento de que a democracia tem um efeito acumulado sobre a desigualdade e não em nível. Além disso, no capítulo 3 também encontramos evidências – na curva de EHII do Gráfico 10 – de que os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade tomavam corpo somente a partir da segunda década democrática, o que pode ser indício de que os efeitos não são imediatos, mas sim resultados do acúmulo e aprendizado de práticas e experiência da competição política democrática.

Para verificar esta pequena modificação na hipótese, utilizamos o mesmo desenho de pesquisa, incluindo as mesmas variáveis instrumentais. Isto porque é possível defender o argumento que a difusão da democracia não só aumenta a probabilidade de um país tornar-se democrático, como também aumenta a probabilidade deste mesmo país continuar sendo governado sob um governo democrático. Do ponto de vista formal, os instrumentos passam nos testes necessários, atendendo aos dois critérios de validade da estimação por variável instrumental.

Mensuramos a persistência democrática a partir da contagem de anos que um país permanece ao longo do tempo em um regime democrático. Mas como é possível que os efeitos da democracia sejam decrescentes no tempo – e também para reduzir o peso na estimação dos casos de alguns poucos países cuja experiência democrática é de longa duração – optamos

por uma transformação logarítmica desta contagem[118]. Testamos a relação nas especificações com efeitos fixos continentais e efeitos fixos temporais nos dados do CGV e EHII e nos dados da análise de longo prazo feita com o BM-GINI. Os resultados são apresentados na Figura 7. Na metade superior estão os gráficos do banco de dados mais recente e na metade inferior os gráficos cujas variáveis mensuram a relação de longo prazo entre democracia e desigualdade.
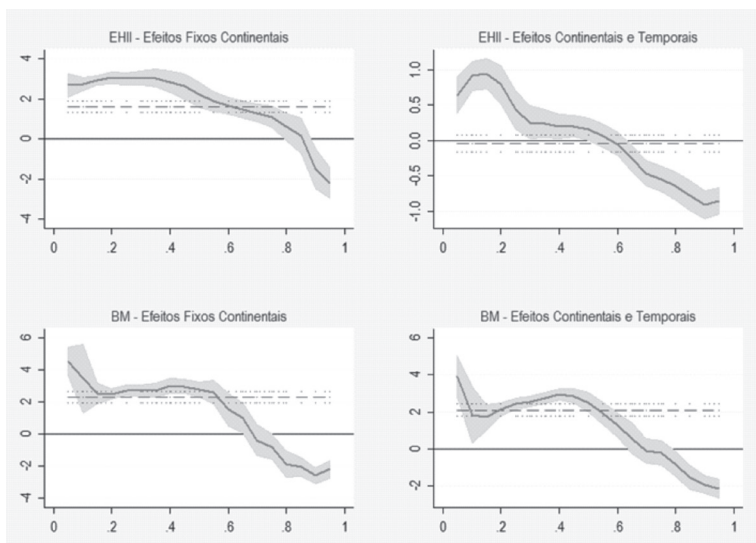
Figura 7 – Efeitos heterogêneos da persistência democrática sobre a desigualdade econômica[119]
Fonte: CGV e UTIP-EHII, BOIX-ROSATO e BM-GINI

[118] Calculamos a variável persistência democrática segundo a seguinte fórmula: **persistência = log (nº de anos democráticos + 1).** A opção pela adição de 1 decorre do fato de que uma ditadura recebe um valor de 0 de número de anos democráticos e não existe uma transformação logarítmica para esse valor. A variável tem média de 0.64 e desvio padrão de 1.29.

[119] Os modelos que mensuram os efeitos heterogêneos da persistência democrática mensurada pelo CGV sobre o EHII são instrumentados por difcont difregiao e horiental llong na especificação com efeitos fixos continentais e por

Mais uma vez os resultados estão de acordo com as propostas teóricas do Capítulo 2, não importando o fato de estarmos medindo a democracia em seu tempo presente ou como o acúmulo da experiência democrática. Nos quatro gráficos encontramos, novamente, fortes evidências de que os efeitos da democracia são heterogêneos ao longo do eixo de desigualdade e são negativos entre os países-anos mais desiguais.

Entre os países-anos mais iguais, justamente aqueles onde não deve existir uma demanda por redistribuição pela cidadania, a competição política democrática tem como efeito principal o aumento da desigualdade econômica. Isto é, a livre e aberta competição entre governo e oposição estimula a adoção de políticas que, em comparação às ditaduras, produzem mais desigualdade econômica, já controlando para os efeitos que diferentes níveis de desenvolvimento ou mesmo o papel da economia de mercado sobre a desigualdade. Em relação a esta consistente evidência do estudo, não temos um argumento teórico explicativo que o justifique, além da mera conjuntura de que este resultado é guiado empiricamente pelos eventos ocorridos nos países que saíram da esfera comunista. Isto porque, enquanto os regimes comunistas produziram os níveis mais baixos de desigualdade econômica, após a transição democrática foram sacudidos por movimentos políticos

---

difmundo e difcont na especificação com efeitos fixos continentais e temporais. Os modelos que mensuram os efeitos heterogêneos da persistência democrática mensurada pela medida modificada de Boix e Rosato sobre o BM-GINI são instrumentados por difcont e difregião no modelo só com efeitos fixos continentais e por difmundo, difcont e difregião no modelo com efeitos fixos continentais e dummies de décadas. Nas quatro especificações os instrumentos atendem aos dois critérios de validade da estimação por variável instrumental.

e econômicos que tiveram como principal consequência um vigoroso aumento da desigualdade[120].

Por outro lado, o resultado mais uma vez indica de maneira categórica a veracidade empírica da hipótese sobre os efeitos heterogêneos da democracia e que este regime político de fato reduz a desigualdade nas sociedades mais desiguais. E a *rationale* deste resultado decorre do fato que com o aumento da desigualdade econômica, existe condições para o surgimento, *ceteris paribus,* de uma maior demanda por redistribuição econômica no seio da cidadania e um decorrente interesse dos partidos em responder efetivamente a esta demanda por meio de plataformas e políticas públicas que tenham como objetivo reduzir a desigualdade. Nos quatro gráficos da Figura 7 este resultado é encontrado, não importando desta forma o horizonte histórico da análise. Os efeitos mais agudos da democracia em direção à redução da desigualdade econômica estão definitivamente concentrados no final da distribuição. Em outras palavras, mesmo que os efeitos negativos estimados em cada uma das especificações variem, parece ser uma evidência incontestável que esses efeitos são mais agudos nos últimos decis da distribuição de desigualdade econômica.

O objetivo principal deste capítulo foi aprofundar a consistência dos achados da relação entre democracia e de-

[120] Por outro lado, verificamos a plausibilidade desta explicação com a introdução de uma variável dummy indicativa de o país ter sido membro ou não da zona de influência comunista. Os resultados positivos dos efeitos da democracia do início da distribuição são amenizados, mas permanecem significantes e positivamente relacionados com a desigualdade econômica nas quatro especificações da Figura 7. Desta forma, existem importantes questões a serem explicadas sobre este fenômeno e que devem ser foco de estudos mais aprofundados.

sigualdade que é muito mais complexa e contextualizada às realidades socioeconômicas do que tal como foi trabalhada até agora pela literatura. Para tal desafio, analisamos esta relação utilizando outros dados de democracia e de desigualdade, outro tipo de mensuração de democracia e, ainda, outro banco de dados com uma abrangência histórica muito maior, mesmo tendo como custo uma reduzida dispersão geográfica. Em todas as seções o resultado foi categórico: a) os efeitos da democracia sobre a desigualdade são heterogêneos; b) em sociedades mais iguais a democracia produz desigualdade; e c) em sociedades mais desiguais a democracia a reduz de maneira contundente. Retomando as duas hipóteses apresentadas no capítulo 2, as conclusões permanecem consistentes após as mais diferentes análises realizadas.

> **H1:** *As democracias possuem em média um efeito negativo sobre a desigualdade.*
>
> **H2:** *Os efeitos negativos da democracia sobre a desigualdade são maiores nas sociedades mais desiguais e tendem a ser menos relevantes em sociedades mais iguais.*

Os dados apresentados respaldam de maneira inequívoca a Hipótese 2. Podemos afirmar que não nos resta dúvidas que os efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica são heterogêneos e tendem a ser negativos nas sociedades mais desiguais. E nas sociedades iguais encontramos evidências robustas que os efeitos são positivos. Por outro lado, em relação à Hipótese 1, dada a existência destes efeitos heterogêneos da democracia, não está claro qual é o seu efeito médio sobre desigualdade. Ademais podemos diagnosticar, inclusive, diante dos achados desta pesquisa que as razões pelas quais a

literatura tem encontrado enormes dificuldades em estimar um resultado sobre a relação entre a democracia e desigualdade que seja consistente com a utilização de modelos econométricos condicionais à média são decorrentes da própria existência destes efeitos heterogêneos.

Além disto, estes achados mostram que a estimação dos efeitos médios da democracia tem pouco significado prático ao reduzirem a complexidade do problema teórico da relação entre as duas variáveis, ignorando informações e interações que são fundamentais para uma verdadeira compreensão do problema. E, por fim, isto também explica porque no capítulo 3, no qual apresentamos a relação descritiva entre as duas variáveis, encontramos poucas diferenças entre as performances das ditaduras e das democracias sobre a desigualdade. Em todas as comparações feitas, tivemos como base a observação da evolução das médias de desigualdade entre democracias e ditaduras no tempo e no horizonte de democratização, o que é forte impedimento para a compreensão adequada de quais sejam os verdadeiros efeitos da democracia sobre a desigualdade econômica.

Considerações finais

Reunimos os achados empíricos dos Capítulo 4 e 5 à luz das proposições teóricas desenvolvidas no Capítulo 2 e da literatura comparada discutida no Capítulo 1. Para isso, reapresentamos a hipótese da heterogeneidade dos efeitos da democracia sobre a desigualdade e discutimos a contribuição que os resultados obtidos podem trazer para a literatura comparada. Além disso, recuperamos alguns resultados inesperados encontrados e discutimos uma futura agenda de pesquisa para tratá-los.

Os esforços desta pesquisa tiveram início a partir da constatação de que, mesmo existindo um razoável consenso teórico na literatura de que os regimes democráticos devem de alguma forma produzir uma melhor distribuição de bens do que os regimes autoritários, os resultados empíricos são inconclusivos e contraditórios. Diante de tal impasse empírico, propusemos uma reformulação teórica, a partir da qual entendemos que os efeitos da democracia sobre a desigualdade devem ser reinterpretados. A principal contribuição teórica da pesquisa reside na constatação tanto teórica quanto empírica de que os efeitos da democracia sobre a desigualdade são heterogêneos e interagem com o próprio nível de desigualdade do país, e, por conseguinte, o suposto tão disseminado na literatura de que esses efeitos seriam homogêneos e independentes do contexto socioeconômico da desigualdade é equivocado. Os efeitos redistributivos da

democracia são distintos, sendo seus efeitos relacionados com o grau de desigualdade da sociedade.

O resultado de que estes efeitos da democracia são heterogêneos é robusto às mais diferentes especificações, dados e formas de mensuração, tanto de democracia quanto de desigualdade, em diferentes cortes temporais e horizontes históricos de análise. Inclusive, quando estendemos o recorte temporal para além da análise mais comum da literatura comparada, que foca os eventos do pós-Segunda Guerra Mundial, devido a maior e melhor disponibilidade de dados, mesmo quando observamos dados que abrangem o período de surgimento dos primeiros regimes representativos democráticos no século XIX, os resultados são claros: os efeitos da democracia sobre a desigualdade são heterogêneos, tendendo a serem positivos entre os países mais iguais e negativo onde a desigualdade é mais exacerbada ao longo de toda história da democracia quanto no pós anos 1960s.

Ademais, o tratamento teórico e empírico utilizado nesta pesquisa nos permitiu encontrar a raiz da inconsistência dos resultados da literatura comparada. Conforme apresentado no capítulo 4, dependendo apenas de pequenas variações na especificação do modelo principal encontramos ora ou outra efeitos médios negativos, positivos ou mesmo nulos da democracia, tal como fora constatado na revisão bibliográfica. Em quase todas as especificações a heterogeneidade dos efeitos da democracia sobre a desigualdade é um resultado evidente, persistente e razoavelmente semelhante.

Em boa parte das análises chegamos a três conclusões básicas principais, arroladas em ordem de importância:

1) a relação entre democracia e desigualdade não deve ser tratada como homogênea e nem seus efeitos são monotônicos ao longo da distribuição da desigualdade;

2) é apenas no final da distribuição que a democracia age de maneira mais contundente na redução da desigualdade, o que fornece indícios da existência de um limiar básico de desigualdade a partir do qual a competição política democrática passa a ter como tema principal a sua efetiva redução;
3) existe uma relativa homogeneidade dos efeitos positivos da democracia no início da distribuição de desigualdade e só apenas quando um país-ano atinge níveis intermediários de desigualdade é que a democracia passa a ver seus efeitos positivos amenizados.

O argumento teórico, a partir do qual elaboramos a hipótese dos efeitos heterogêneos, refere-se à necessidade de uma convergência na competição política eleitoral entre os interesses político-eleitorais dos partidos – o lado da oferta de plataformas e políticas públicas que sejam eleitoralmente rentáveis – e as clivagens sobre as quais uma potencial maioria dos eleitores tem interesse em ser atendido – o lado da demanda por parte de parcela majoritária de cidadãos por políticas públicas e plataformas. Somente nas sociedades mais desiguais tanto os partidos políticos terão interesse em ofertar políticas redistributivas, quanto tende a surgir no seio da cidadania uma demanda por redistribuição por parte de uma maioria de eleitores. Nesse cenário, o saldo líquido do cálculo do custo benefício de atrair as classes menos favorecidas é positivo para os partidos, superando os ganhos que seriam obtidos atraindo as classes com renda acima da mediana. E do lado da demanda por redistribuição, a exacerbação da desigualdade tende a eclipsar outras potenciais clivagens que possam dividir as classes menos favorecidas em diferentes grupos e frentes políticas, permitindo uma ação eleitoral coordenada – seja ela organizada pelos partidos ou pela própria cidadania.

Diante destas ponderações teóricas e dos claros resultados empíricos surge, como subproduto, a sugestão de uma nova interpretação das implicações do teorema do eleitor mediano, quando aplicado à questão da redistribuição econômica, levando em conta a questão da multidimensionalidade da política e como os partidos e o eleitorado operam para reduzir a complexidade desta disputa. Diferentemente das conclusões de Meltzer e Richard (1981), de que a política redistributiva é determinada pela posição econômica do eleitor/cidadão mediano – assumindo sufrágio universal, esse teorema delimita na realidade o potencial máximo da força dos mais pobres dentro de determinada sociedade.

Em outras palavras, o teorema delimita o poder das classes menos favorecidas quando conseguem resolver seus problemas de ação coletiva (seja essa ação organizada por cima pelos partidos ou de maneira horizontal pela própria sociedade) e demandar de maneira uníssona uma resposta política por parte dos partidos – que competem pela formação de alguma maioria – ao problema da desigualdade econômica. Dada a sua pior posição na escala de renda, estes grupos possuem menos recursos para serem transferidos para o campo da política e seu principal instrumento político em uma democracia é, portanto, a ação organizada via escolha eleitoral. Assim, a melhor forma de conseguirem atingir e modificar de fato o status quo do sistema político é por meio da sua atuação coletiva e coordenada.

O máximo de coordenação possível é obtido quando todos os indivíduos abaixo da renda mediana votam conjuntamente para pressionar os líderes democráticos em prol de determinada pauta eleitoral. Por outro lado, a relação heterogênea entre democracia e desigualdade é um argumento

probabilístico, sendo possível encontrar casos nos quais a existência de uma grande desigualdade na sociedade não tenha resultado em uma maior pressão por políticas para a sua redução caso exista outra clivagem que, por uma razão ou outra, divida a metade mais pobre da distribuição de renda, como, por exemplo, questões de clivagens políticas étnicas, raciais ou de valores, entre outras, seja esta demanda espontânea ou forjada pelas elites políticas. Contudo é patente que quanto maior for a desigualdade, maior será a probabilidade que o sistema político passe a operar em direção à redução da desigualdade.

A hipótese dos efeitos heterogêneos da democracia se adequa para explicar tanto o processo político econômico ocorrido no Leste Europeu quanto o latino-americano. Após a democratização dos antigos satélites soviéticos, houve aumento dramático da desigualdade, enquanto na América Latina, a tendência de evolução da desigualdade é negativa, sendo o único subcontinente no século XXI onde a desigualdade realmente diminuiu. A América Latina é justamente a região do planeta mais adequada para se encontrar tal efeito, por ser onde encontramos os índices mais altos de desigualdade.

Por outro lado, o nosso arcabouço teórico proposto no capítulo 2 é adequado para explicar com mais precisão porque apenas nas sociedades mais desiguais a democracia é um agente redutor da desigualdade, enquanto nas sociedades intermediárias e nas mais iguais o debate redistributivo não ocupa espaço central na competição político-eleitoral. A proposta teórica apresentada não é suficiente, em nossa opinião, para explicar em seus pormenores porque nos países mais iguais a democracia produz desigualdade. A ausência de uma clivagem redistributiva implicaria de maneira mais imediata em um não efeito da democracia sobre a desigualdade, mas o

que encontramos de maneira consistente ao longo dos diversos modelos apresentados no capítulo 4 foi um efeito positivo da democracia. Desta maneira, parece existir a partir dos dados analisados um mecanismo por meio do qual a competição política produz mais desigualdade que as ditaduras em sociedades mais igualitárias.

A compreensão destes mecanismos políticos que conectam a experiência democrática nessas sociedades com uma distribuição dos recursos econômicos de forma mais desigual é um quebra-cabeça teórico a ser debatido em futuras pesquisas. A primeira vista, o resultado parece estar conectado com os eventos ocorridos no Leste Europeu e países da esfera de influência soviética que após a democratização apresentaram tendência aguda de crescimento da desigualdade, tanto nos países que se democratizaram quanto nos que permaneceram autoritários. Contudo, mesmo após a inclusão de uma variável dummy para esses países os efeitos da democracia sobre a desigualdade permaneceram positivos entre os países-anos mais iguais, o que indica que existem outros mecanismos que conectam a democracia a mais desigualdade em sociedades mais iguais que ainda não foram debatidos.

Por fim, o último elemento a ser destacado é o método adotado para a identificação de democracia e a estimação de seus efeitos sobre a desigualdade, purificados do potencial problema da relação inversa entre desigualdade sobre a probabilidade de democratização e consolidação democrática. Conforme extensamente discutido na primeira seção do Capítulo 4, as variáveis de difusão de democracia e de localização longitudinal de um país são instrumentos válidos que identificam democracia adequadamente ao atender os dois critérios necessários para a validade do método de variável instrumental:

(a) ser correlacionado com a variável endógena democracia; e (b) não possuir um efeito causal na variável dependente desigualdade econômica (ou, por extensão, no termo de erro da equação estimada).

Ademais, durante a avaliação dos instrumentos, foi constatado que o processo de difusão de democracia é mais complexo do que o teorizado na literatura e, por conseguinte, são necessárias pesquisas mais aprofundadas sobre os processos e mecanismos por meio dos quais o aumento do número de democracias no mundo pode (ou não) afetar a probabilidade de um país democratizar-se e/ou consolidar um regime democrático.

Em primeiro lugar, os efeitos de difusão são mais fortes e positivos quanto mais próximos do país afetado forem as outras democracias. Em segundo lugar, foi constatado que após controlarmos os efeitos da difusão de democracia em circunscrições geográficas mais próximas do país afetado, o aumento da proporção de democracias no mundo está negativamente relacionado com a democracia no país afetado. Este foi um resultado inesperado, demandando análises mais detalhadas em futuras pesquisas e não pode ser considerado definitivo uma vez que as variáveis de controle foram propostas para os potenciais efeitos espúrios na relação entre democracia e desigualdade, não tendo sido discutidas em relação aos próprios determinantes da democratização e/ou consolidação democrática.

Apêndice A - Variável instrumental

O principal objetivo de uma pesquisa que busca avaliar os efeitos de uma variável independente em uma variável dependente é garantir a validade da relação causal proposta. No plano ideal, a melhor maneira de garantir que a relação entre duas variáveis seja causal seria trabalhar com contrafactuais, ou seja, observar a presença ou ausência da variável de interesse, dadas condições ambientais exatamente iguais. Uma forma clássica de garantia contrafactual é o uso de um experimento randômico. Contudo em estudos observacionais, aqueles nos quais não é possível o uso da técnica experimental, é necessário a utilização de métodos que permitam a superação de problemas de autosseleção[121].

Para descrever essa questão de maneira precisa, definimos o tratamento como uma variável binária; $D_i = \{0, 1\}$. O resultado de interesse é definido por Y_i. A questão a ser pesquisada é se a variação em D_i afeta o valor de Y_i. Assim, para qualquer indivíduo *i* existem dois resultados potenciais:

[121] Angrist e Pischke (2008) ilustram essa questão discutindo se o atendimento hospitalar melhora ou piora a saúde de seus pacientes. Obviamente, a mera comparação entre os que foram ao hospital e aqueles que não foram não é suficiente, pois obviamente, quem busca um hospital possui uma condição de saúde mais frágil.

$$resultado\ potencial = \begin{cases} Y_{0i}, & se\ D_i = 0 \\ Y_{1i}, & se\ D_i = 1 \end{cases} \quad \text{(Eq. A.1)}$$

Caso fosse possível observar os dois resultados potenciais, o efeito de D_i sobre Y_i seria facilmente calculado subtraindo-se $Y_{1i} - Y_{0i}$ para cada indivíduo e assim estimaríamos o efeito causal calculando a diferença média encontrada na amostra. Contudo, inevitavelmente só podemos ver um dos dois resultados potenciais. Outra forma possível é atribuir os tratamentos $D_i = 0$ e $D_i = 1$ de forma aleatória na amostra observada, de maneira a controlar para possíveis fatores que interfiram na relação (fatores de confusão). A atribuição aleatória do tratamento resolveria os problemas de seleção, pois torna D_i independente dos resultados potenciais. O experimento assegura, portanto, que a relação causal de interesse seja independente dos resultados potenciais. (ANGRIST; PISCHKE, 2008).

Em estudos observacionais o ideal experimental é muitas vezes impraticável. O estudo de regimes políticos comparado é exemplo típico desses casos. Por razões óbvias, não é possível atribuir o tipo de regime de dado país aleatoriamente. As características de cada um dos indivíduos (nesse caso os países) da população de países se autosseleciona a adotar certo tipo de regime. Assim, é necessário controlarmos a análise de consequências da democracia para as variáveis conectadas ao próprio processo de democratização.

A primeira forma de aproximar os estudos observacionais do ideal experimental reside na utilização de controles e assumir a suposição da seleção em observáveis. Isto é, assumir a suposição de que as variáveis que interferem na relação causal são conhecidas e observáveis e, portanto, podem ser controladas (ANGRIST: PISCHKE, 2008).

Outra ferramenta mais sofisticada para permitir a inferência causal em um cenário de pesquisa observacional é o uso de uma variável instrumental (IV), que permite solucionar o problema da autosseleção. Em nosso tema de estudo, o problema da autosseleção é claro, uma vez que a literatura sobre a redemocratização discute os efeitos que a própria desigualdade econômica possui sobre a possibilidade de democratização e consolidação democrática (BOIX, 2003; ACEMOGLU; ROBINSON, 2006; HOULE, 2009).

Suponha as seguintes equações sobre a relação entre democracia (D) e desigualdade (Y):

$$Y_i \equiv f_i\,(s) \qquad \text{(Eq. A.2)}$$

$$f_i\,(s) = \alpha 1 + \beta * D_i + \delta 1 * \boldsymbol{X_i} + \varepsilon_i \qquad \text{(Eq. A.3)}$$

onde D_i é o indicador de democracia, $\boldsymbol{X_i}$ é o vetor de variáveis de controle e ε_i é o termo de erro. O problema crucial dessa equação é que o termo de erro é correlacionado com D_i; caso não fosse, estaríamos assumindo que não existe qualquer relação entre desigualdade e democracia em um país, o que parece pouco plausível:

$$Cov\,(D_i\,, \varepsilon_i) \neq 0. \qquad \text{(Eq. A.4)}$$

Com isso uma estimação pelo tradicional método de MQO (mínimos quadrados ordinários) gerarão resultados inconsistentes e enviesados, pois a equação não atende às Hipóteses de Gauss-Markov. O método de IV fornece uma solução a esse problema. Para isso é necessário escolher uma variável instrumental $\boldsymbol{Z_i}$ que não esteja na equação A.3 e que satisfaça três condições. (WOOLDRIDGE, 2010):

Primeiro, $\boldsymbol{Z_i}$ deve ser não correlacionado com o termo de erro ε_i.

$$Cov\,(Z_i\,, \varepsilon_i) = 0. \qquad \text{(Eq. A.5)}$$

Isto é $\boldsymbol{Z_i}$ deve ser exógeno à equação A.3, não sendo, portanto, um determinante da desigualdade econômica dentro de um determinado país.

Segundo, $\boldsymbol{Z_i}$ deve ser parcialmente correlacionado com D_i, uma vez controlada todas as outras variáveis de controle da equação A.3.

$$Cov\,(Z_i\,, D_i \mid \boldsymbol{X_i}) \neq 0. \qquad \text{(Eq. A.6)}$$

A forma mais simples de identificar essa relação é estimando a equação:

$$D_i = \alpha 1 + \boldsymbol{\rho} * \boldsymbol{Z_i} + \delta 2 * \boldsymbol{X_i} + \xi_i \text{ ; onde } \rho \neq 0 \qquad \text{(Eq. A.7)}$$

Quando $\boldsymbol{Z_i}$ satisfaz as condições A.5 e A.6 ela torna-se um instrumento em potencial da equação A.3. O segundo passo na análise é inserir a Equação A.7 na Equação Principal A.3:

$$f_i\,(s) = \alpha 3 + \lambda * Z_i + \delta 3 * \boldsymbol{X_i} + \varepsilon_i \qquad \text{(Eq. A.8)}$$

rearranjando, assim, o termo de erro na forma reduzida:

$$u_i = \varepsilon_i + \beta * \xi_i \; ; \qquad \text{(Eq. A.9)}$$

e o coeficiente do efeito do tratamento D_i:

$$\lambda = \beta * \boldsymbol{\rho} \qquad \text{(Eq. A.10)}$$

A última e final condição, denominada como restrição de exclusão, assume que a relação entre $\boldsymbol{Z_i}$ e $\boldsymbol{Y_i}$ é única e exclusivamente transmitida por D_i. Desta forma, todo e qualquer efeito de $\boldsymbol{Z_i}$ estimado na equação A.8 é de fato o efeito de D_i em $\boldsymbol{Y_i}$ purificado do problema de causalidade reversa, ou qualquer outro problema de endogeneidade no termo de erro. Assim, segundo os pressupostos assumidos $\boldsymbol{u_i}$ é não correlacionado com todas as variáveis explanatórias de A.8 e uma regressão de MQO pode assim estimar os parâmetros reduzidos de forma consistente[122] (WOOLDRIDGE, 2010).

Conforme indicado no Capítulo 3, a variável selecionada como instrumento da relação entre democracia e desigualdade é o próprio processo de difusão de democracia no mundo, que afeta a desigualdade econômica de um dado país, única e exclusivamente pelos efeitos que possui sobre o seu regime político.

[122] Do ponto de vista estritamente econométrico a hipótese de restrição de exclusão é decorrência lógica da condição 1. Apenas a apresentamos para sublinhar a importância da hipótese de que um regime político democrático, isto é, a competição política eleitoral, seja o único meio de transmissão dos efeitos da difusão de democracia sobre a desigualdade econômica.

Apêndice B - Regressão quantílica

A Regressão Quantílica (RQ) é uma ferramenta econométrica desenvolvida para analisar relações entre variáveis além das variações sobre a média. Ela permite captar efeitos ao longo de toda a distribuição da variável dependente. Para Angrist e Pischke (2008) é uma ferramenta poderosa que torna a modelagem das distribuições uma tarefa fácil além de ter propriedades que a assemelham à estimação clássica por Mínimos Quadrados Ordinários (MQO).

Suponha que estamos interessado na distribuição de uma variável aleatória contínua $\boldsymbol{Y_i}$. Sua função quantílica condicional (FQC) no quantil τ dado um vetor de regressores $\boldsymbol{X_i}$ pode ser definida como:

$$Q_\tau\ (Y_i|\ X_i) = \ F_y^{-1}\ (\tau\ |\ X_i) \qquad \text{(Eq. B.1)}$$

onde $F_y^{-1}\ (\tau\ |\ X_i)$ é a função de distribuição para $\boldsymbol{Y_i}$ em $\boldsymbol{Y}$, condicionado em $\boldsymbol{X_i}$. Quando $\tau = 0.1$, por exemplo, $Q_\tau\ (Y_i|\ X_i)$ descreve o menor decil de $\boldsymbol{Y_i}$ dado $\boldsymbol{X_i}$, enquanto $\tau = 0.5$ descreve a mediana condicional. Com a visão sobre toda a distribuição de $\boldsymbol{Y_i}$, podemos descrever a dispersão dos efeitos das variáveis presentes no componente $\boldsymbol{X_i}$. Assim como a regressão por MQO ajusta um modelo linear para $\boldsymbol{Y_i}$ minimizando o erro

quadrático esperado, a RQ ajusta um modelo linear usando a Função de Perda $p_\tau(u)$[123] (ANGRIST e PISCHKE, 2008).

Assim como problemas de endogeneidade em MQO podem ser resolvido por meio do uso de variável instrumental, a RQ também é flexível à incorporação de um instrumento. O estimador de IV-RQ introduzido por Abadie, Angrist e Imbens (2002) assumem as mesmas suposições das estimações em variável instrumental para o efeito do tratamento localizado (LATE) para os compliers (tratados a quem foram atribuídos o instrumento). Os parâmetros de interesse são definidos deste modo; para $\tau \in (0, 1)$, assumimos que existe um α_τ e um β_τ na seguinte equação:

$$Q_\tau\ (Y_i|X_i\ ; D_i; D_{1i} > D_{0i}) = \alpha_\tau * D_i + \beta_\tau * X_i \qquad \text{(Eq. B.2)}$$

onde o lado esquerdo da equação denota o quantil τ de dado $\boldsymbol{X_i}$ e $\boldsymbol{D_i}$ para os compliers. Assim α_τ e β_τ são coeficientes de RQ para os compliers.

[123] $p_\tau(u) = 1(u > 0) * \tau|u| + 1(u \leq 0) * (1 - \tau)|u|$

Apêndice C - Estimador bootstrap do erro padrão em regressão quantílica

A obtenção de erros padrões para os coeficientes estimados por meio de uma regressão quantílica (RQ) não é uma tarefa trivial. Rogers (1993) entende que não existem respostas bem definidas em RQ mesmo quando os pressupostos são atendidos, ainda que existam algumas demonstrações que sugerem estimadores para parâmetros assintóticos de variância e covariância (KOENKER e BASSET JR, 1978; ROGERS, 1993; KOENKER, 2005). Diante destas dificuldades, ainda mais agravadas com o aumento da incerteza dos coeficientes decorrente da estimação do 1º passo com variável instrumental, uma estratégia para obter erros padrões adequados e que exija menos pressupostos é por meio da técnica de *bootstrapping*, apesar do custo de maior tempo de computação dos estimadores (EFRON, 1979; EFRON, 1982).

O método bootstrapping é simples, mas computacionalmente desgastante e permite inclusive a estimação de erros padrões para qualquer estimador mesmo se não existir uma solução analítica para o problema (GOULD, 1993). Ele consiste na estimação dos erros padrões não paramétricos com base na seleção de K novas amostras de mesmo tamanho N da amostra inicial a partir dos próprios dados desta mesma

amostra inicial e cuja seleção é aleatória e com reposição. Neste sorteio, algumas das observações originais apareceram uma vez, algumas mais de uma vez e outras não apareceram. O *bootstrapping* considera assim a amostra uma população finita a partir do qual é possível selecionar novas amostras (CAMERON; TRIVEDI, 2005).

A partir destas K novas amostras é possível repetidamente re-estimar a mesma estatística, formando uma lista de dados secundária composta pelos resultados das K replicações do estimador, no caso os coeficientes da RQ (GOULD, 1993). Em seguida, a partir desta lista secundária de estatísticas estimadas é possível calcular o desvio padrão da estimativa dos coeficientes de RQ usando a fórmula:

$$Erro\ Padrão\ de\ \beta_{boot} = \frac{1}{K-1} * \sqrt{\sum(b_i - \bar{b})^2} \quad \text{(Eq. C.1)}$$

onde $Erro\ Padrão\ de\ \beta_{boot}$ é a estimativa do erro padrão do coeficiente, b_i é o coeficiente estimado em cada uma das novas amostras ou replicação, $\bar{b}$ é o valor médio do coeficiente estimado a partir de todas as novas amostras e K é o número de replicações realizadas.

A acurácia da aproximação da estimação dos $Erro\ Padrão\ de\ \beta_{boot}$ aumenta tanto com o aumento de N quanto com o aumento do número das K replicações. Como os erros padrões por bootstrapping são consistentes, estes podem ser utilizados nas fórmulas assintóticas tradicionais para o cálculo de intervalos de confiança e testes de hipóteses que sejam assintoticamente válidos. (CAMERON E TRIVEDI, 2005).

Referências

ABADIE, A.; ANGRIST, J.; IMBENS, G. Instrumental variables estimates of the effect of subsidized training on the quantiles of trainee earnings. **Econometrica,** v. 70, n. 1, p. 91-117, 2002.

ABRAMS, B. A.; SETTLE, R. F. Women's suffrage and the growth of the welfare state. **Public Choice,** v. 100, n. 3-4, p. 289-300, 1999. ISSN 0048-5829.

ACEMOGLU, D. et al. Income and Democracy. **American Economic Review,** v. 98, n. 3, p. 808-842, 2008.

ACEMOGLU, D.; ROBINSON, J. A. **Economic Origins of Dictatorship and Democracy**. Cambridge Books, 2006.

ADSERA, A.; BOIX, C. Trade, democracy, and the size of the public sector: the political underpinnings of openness. **International Organization,** v. 56, n. 2, p. 229-262, 2002. ISSN 1531-5088.

AGHION, P.; HOWITT, P.; GARCÍA-PEÑALOSA, C. **Endogenous growth theory**. MIT press, 1998.

ALESINA, A.; BAQIR, R.; EASTERLY, W. Redistributive public employment. **Journal of Urban Economics,** v. 48, n. 2, p. 219-241, 2000. ISSN 0094-1190.

ALESINA, A.; GLAESER, E. L. **Fighting poverty in the US and Europe:** a world of difference. 2004.

ALVAREZ, M. et al. Classifying political regimes. **Studies in comparative international development,** v. 31, n. 2, p. 3-36, 1996. ISSN 0039-3606.

ANGRIST, J.; KRUEGER, A. B. **Instrumental variables and the search for identification:** from supply and demand to natural experiments. National Bureau of Economic Research. 2001

ANGRIST, J. D.; PISCHKE, J.-S. **Mostly harmless econometrics:** an empiricist's companion. Princeton university press, 2008. ISBN 1400829828.

ANSELL, B.; SAMUELS, D. Inequality and democratization: a contractarian approach. **Comparative Political Studies**, 2010. ISSN 0010-4140.

______. **Inequality and democratization**: an elite-competition approach. Cambridge University Press, 2014.

ARISTOTELES. **A política**. São Paulo: Saraiva, 2005.

ARROW, K. J. Uncertainty and the welfare economics of medical care. **The American economic review**, p. 941-973, 1963. ISSN 0002-8282.

ATKINSON, A. B.; BRANDOLINI, A. Promise and pitfalls in the use of "secondary" data-sets: Income inequality in OECD countries as a case study. **Journal of economic literature**, p. 771-799, 2001. ISSN 0022-0515.

AUSTEN-SMITH, D.; WALLERSTEIN, M. **Redistribution in a divided society**. Northwestern University, Center for

Mathematical Studies in Economics and Management Science. 2003

AUTOR, D. **The polarization of job opportunities in the US labor market:** Implications for employment and earnings. Center for american progress and the Hamilton Project, 2010.

AUTOR, D.; KATZ, L. F.; KEARNEY, M. S. **The polarization of the US labor market**. National Bureau of Economic Research. 2006

AUTOR, D. H.; KATZ, L. F.; KEARNEY, M. S. **Trends in US wage inequality:** re-assessing the revisionists. National Bureau of Economic Research, 2005.

AVELINO, G.; BROWN, D. S.; HUNTER, W. The effects of capital mobility, trade openness, and democracy on social spending in Latin America, 1980–1999. **American Journal of Political Science,** v. 49, n. 3, p. 625-641, 2005. ISSN 1540-5907.

BABONES, S. J. Income inequality and population health: correlation and causality. **Social Science & Medicine,** v. 66, n. 7, p. 1614-1626, 2008. ISSN 0277-9536.

BABONES, S. J.; ALVAREZ-RIVADULLA, M. J. Standardized Income Inequality Data for Use in Cross-National Research. **Sociological Inquiry,** v. 77, n. 1, p. 3-22, 2007. ISSN 1475-682X.

BAKER, P. In State of the Union Address, Obama Vows to Act Alone on the Economy. **The New York Times**, New York, 2014.

BARTELS, L. M. **Unequal democracy**. New York: Russell Sage Foundation, 2008.

BAUM, C. F.; SCHAFFER, M. E.; STILLMAN, S. Enhanced routines for instrumental variables/GMM estimation and testing. **Stata Journal,** v. 7, n. 4, p. 465-506, 2007.

BECKFIELD, J. European integration and income inequality. **American Sociological Review,** v. 71, n. 6, p. 964-985, 2006. ISSN 0003-1224.

______. Remapping Inequality in Europe The Net Effect of Regional Integration on Total Income Inequality in the European Union. **International Journal of Comparative Sociology,** v. 50, n. 5-6, p. 486-509, 2009. ISSN 0020-7152.

BERAMENDI, P.; ANDERSON, C. J. **Democracy, inequality, and representation in comparative perspective**. Russell Sage Foundation, 2008. ISBN 0871540886.

BERGH, A. On the counterfactual problem of welfare state research: how can we measure redistribution? **European Sociological Review,** v. 21, n. 4, p. 345-357, 2005. ISSN 0266-7215.

BEYER, H.; ROJAS, P.; VERGARA, R. Trade liberalization and wage inequality. **Journal of Development Economics,** v. 59, n. 1, p. 103-123, 1999. ISSN 0304-3878.

BIRDSALL, N.; HAMOUDI, A. Commodity Dependence, Trade, and Growth: When 'Openness' is not Enough. **Center for Global Development Working Paper,** v. 7, 2002.

BOIX, C. **Democracy and redistribution**. Cambridge University Press, 2003. ISBN 0521532671.

______. Origins and persistence of economic inequality. **Annual Review of Political Science,** v. 13, p. 489-516, 2010. ISSN 1094-2939.

______. Redistribution policies in a globalized world. **Making globalization socially sustainable**, p. 261, 2011.

BOIX, C.; MILLER, M.; ROSATO, S. A complete data set of political regimes, 1800–2007. **Comparative Political Studies**, 2012. ISSN 0010-4140.

BOIX, C.; ROSATO, S. **A complete data set of political regimes, 1800-1999**. Chicago: department of political science, University of Chicago, 2001.

BOLLEN, K. A. Issues in the comparative measurement of political democracy. **American Sociological Review**, p. 370-390, 1980. ISSN 0003-1224.

BOLLEN, K. A.; GRANDJEAN, B. D. The dimension(s) of democracy: Further issues in the measurement and effects of political democracy. **American Sociological Review**, p. 651-659, 1981. ISSN 0003-1224.

BOLLEN, K. A.; JACKMAN, R. W. Political democracy and the size distribution of income. **American Sociological Review**, p. 438-457, 1985. ISSN 0003-1224.

BOUND, J.; JAEGER, D. A.; BAKER, R. M. Problems with instrumental variables estimation when the correlation between the instruments and the endogenous explanatory variable is weak. **Journal of the American statistical association,** v. 90, n. 430, p. 443-450, 1995. ISSN 0162-1459.

BOURGUIGNON, F.; MORRISSON, C. Inequality among world citizens: 1820-1992. **American economic review**, p. 727-744, 2002. ISSN 0002-8282.

BREUNIG, C. Reduction, stasis, and expansion of budgets in advanced democracies. **Comparative political studies,** v. 44, n. 8, p. 1060-1088, 2011. ISSN 0010-4140.

BRINKS, D.; COPPEDGE, M. Diffusion Is No Illusion Neighbor Emulation in the Third Wave of Democracy. **Comparative political studies,** v. 39, n. 4, p. 463-489, 2006. ISSN 0010-4140.

BRUNE, N.; GARRETT, G. The globalization Rorschach test: international economic integration, inequality, and the role of government. **Annu. Rev. Polit. Sci.,** v. 8, p. 399-423, 2005. ISSN 1094-2939.

BRUNE, N.; GARRETT, G.; KOGUT, B. The International Monetary Fund and the global spread of privatization. **IMF Staff Papers**, p. 195-219, 2004. ISSN 1020-7635.

BUNCE, V. J.; WOLCHIK, S. L. International diffusion and postcommunist electoral revolutions. **Communist and Post-Communist Studies,** v. 39, n. 3, p. 283-304, 2006. ISSN 0967-067X.

CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics:** methods and applications. Cambridge university press, 2005. ISBN 1139444867.

CAMERON, D. R. The expansion of the public economy: A comparative analysis. **American political science review,** v. 72, n. 4, p. 1243-1261, 1978. ISSN 1537-5943.

CARDOSO, F. H. **A soma e o resto:** um olhar sobre a vida aos 80 anos. Civilização Brasileira, 2011.

CARDOSO, F. H.; FALETTO, E. [1969]. **Desenvolvimento e dependência na América Latina:** Ensaio de interpretação sociológica. Rio de Janeiro: Civilização Brasileira, 2010.

CHAN, S. Democracy and inequality: tracking welfare spending in Singapore, Taiwan and South Korea. In: MIDLARSKY, M. (Ed.). **Inequality, democracy, and economic development**. United Kingdom: Cambridge University Press, 1997.

CHEIBUB, J. A.; GANDHI, J.; VREELAND, J. R. Democracy and dictatorship revisited. **Public Choice,** v. 143, n. 1-2, p. 67-101, 2010. ISSN 0048-5829.

CHONG, A. Inequality, democracy, and persistence: is there a political Kuznets curve? **Economics & Politics,** v. 16, n. 2, p. 189-212, 2004. ISSN 1468-0343.

CORRÊA, D. S. **Conditional Cash Transfer Programs and Their Electoral Effects**. Annual Meeting of the Australian Political Studies Association, 2010.

CUTRIGHT, P. Inequality: a cross-national analysis. **American Sociological Review**, p. 562-578, 1967.

DE MAIO, F. G. Income inequality measures. **Journal of epidemiology and community health,** v. 61, n. 10, p. 849-852, 2007. ISSN 1470-2738.

DE MESQUITA, B. B. et al. **The Logic of Political Survival**. Cambridge: The MIT Press, 2005. ISBN 0262524406.

DEININGER, K.; SQUIRE, L. A new data set measuring income inequality. **The World Bank Economic Review,** v. 10, n. 3, p. 565-591, 1996. ISSN 0258-6770.

DOLLAR, D.; KRAAY, A. **Trade, growth, and poverty**. World Bank, Development Research Group, Macroeconomics and Growth, 2001.

DOWNS, A. An economic theory of political action in a democracy. **The Journal of Political Economy**, p. 135-150, 1957. ISSN 0022-3808.

DRAKE, P. W. The international causes of democratization, 1974-1990. **The origins of liberty:** political and economic liberalization in the modern world, p. 70-91, 1998.

DUNNING, T. **Crude democracy:** natural resource wealth and political regimes. 2008.

EFRON, B. Bootstrap methods: Another look at the jackknife. **The Annals of Statistics,** v. 7, n. 1, p. 1-26, 1979.

______. **The jackknife, the bootstrap and other resampling plans**. SIAM, 1982.

EICHENGREEN, B.; LEBLANG, D. Democracy and globalization. **Economics & Politics,** v. 20, n. 3, p. 289-334, 2008. ISSN 1468-0343.

ELKINS, Z. Gradations of democracy? Empirical tests of alternative conceptualizations. **American Journal of Political Science**, p. 293-300, 2000. ISSN 0092-5853.

ESPING-ANDERSEN, G. As três economias políticas do Welfare State. **Lua Nova:** Revista de Cultura e Política, n. 24, p. 85-116, 1991. ISSN 0102-6445.

EVANS, P. B. **Dependent development:** the alliance of multinational, state, and local capital in Brazil. Princeton University Press, 1979. ISBN 0691021856.

______. **Embedded autonomy:** states and industrial transformation. Cambridge University Press, 1995.

FERNANDEZ, R. M. Skill-biased technological change and wage inequality: evidence from a plant retooling1. **American Journal of Sociology,** v. 107, n. 2, p. 273-320, 2001.

FRANK, T. **What's the matter with Kansas?:** how conservatives won the heart of America. Macmillan, 2007. ISBN 1429900326.

FRANKEL, J. A. **Globalization of the economy**. National Bureau of Economic Research. 2000.

GAKIDOU, E. et al. Increased educational attainment and its effect on child mortality in 175 countries between 1970 and 2009: a systematic analysis. **The Lancet,** v. 376, n. 9745, p. 959-974, 2010. ISSN 0140-6736.

GALBRAITH, J. K. **The predator state:** how conservatives abandoned the free market and why liberals should too. Simon and Schuster, 2008. ISBN 1416566848.

______. Inequality and economic and political change: a comparative perspective. **Cambridge Journal of Regions, Economy and Society**, 2010. ISSN 1752-1378.

______. **Inequality and instability:** a study of the world economy just before the great crisis. Oxford University Press, 2012. ISBN 019985565X.

GALBRAITH, J. K.; KUM, H. Inequality and economic growth: A global view based on measures of pay. **CESifo Economic Studies,** v. 49, n. 4, p. 527-556, 2003. ISSN 1610-241X.

______. Estimating the inequality of household incomes: a statistical approach to the creation of a dense and consistent global data set. **Review of Income and Wealth,** v. 51, n. 1, p. 115-143, 2005.

GALOR, O.; TSIDDON, D. Technological progress, mobility, and economic growth. **The American Economic Review**, p. 363-382, 1997. ISSN 0002-8282.

GARRETT, G. Global markets and national politics: collision course or virtuous circle? **International Organization,** v. 52, n. 4, p. 787-824, 1998a. ISSN 1531-5088.

______. **Partisan politics in the global economy**. Cambridge University Press, 1998b. ISBN 0521446902.

______. Globalization's missing middle. **Foreign Affairs**, p. 84-96, 2004. ISSN 0015-7120.

GASIOROWSKI, M. J. 10 Political regimes and industrial wages: a cross-national analysis. **Inequality, democracy, and economic development**, p. 244, 1997. ISSN 052157675X.

GAURI, V.; KHALEGHIAN, P. Immunization in developing countries: its political and organizational determinants. **World Development,** v. 30, n. 12, p. 2109-2132, 2002. ISSN 0305-750X.

GERRING, J.; THACKER, S. C.; ALFARO, R. Democracy and human development. **The Journal of Politics,** v. 74, n. 01, p. 1-17, 2012. ISSN 1468-2508.

GILENS, M. **Why Americans hate welfare:** race, media, and the politics of antipoverty policy. University of Chicago Press, 2009. ISBN 0226293661.

GIMET, C.; LAGOARDE-SEGOT, T. A closer look at financial development and income distribution. **Journal of Banking & Finance,** v. 35, n. 7, p. 1698-1713, 2011. ISSN 0378-4266.

GINI, C. Variabilità e mutabilità. **Reprinted in memorie di metodologica statistica** (Ed. Pizetti E, Salvemini, T). Rome: Libreria Eredi Virgilio Veschi, v. 1, 1912.

GLEDITSCH, K. S.; WARD, M. D. Diffusion and the international context of democratization. **International organization,** v. 60, n. 04, p. 911-933, 2006. ISSN 1531-5088.

GOLDIN, C.; MARGO, R. A. Wages, prices, and labor markets before the Civil War. In: (Ed.). **Strategic factors in nineteenth century american economic history: a volume to honor Robert W. Fogel**: University of Chicago Press, 1992. p. 67-104.

GOULD, W. Quantile regression with bootstrapped standard errors. **Stata Technical Bulletin,** v. 2, n. 9, 1993.

GOUVEIA, M.; MASIA, N. A. Does the median voter model explain the size of government?: Evidence from the states. **Public Choice,** v. 97, n. 1-2, p. 159-177, 1998. ISSN 0048-5829.

GRADSTEIN, M.; MILANOVIC, B. Does liberté = égalité? A survey of the empirical links between democracy and inequality with some evidence on the transition economies. **Journal of Economic Surveys,** v. 18, n. 4, p. 515-537, 2004. ISSN 1467-6419.

GROSFELD, I.; SENIK, C. The emerging aversion to inequality. **Economics of Transition,** v. 18, n. 1, p. 1-26, 2010. ISSN 1468-0351.

GROUP, W. B. **World Development Indicators 2013**. World Bank Publications, 2013.

HADENIUS, A.; TEORELL, J. Assessing alternative indices of democracy. **C&M Working Papers**, 6, 2005.

HANKISS, E. A “grande coalizão”: as mudanças na Hungria. **Lua Nova:** Revista de Cultura e Política, n. 22, p. 35-68, 1990a. ISSN 0102-6445.

______. **East European Alternatives**. Clarendon Press Oxford, 1990b.

HELD, D. **Global transformations:** politics, economics and culture. Stanford University Press, 1999. ISBN 0804736278.

HERZER, D.; NUNNENKAMP, P. **Income inequality and health:** new evidence from panel data. Kiel Working Papers. 2011

HERZER, D.; VOLLMER, S. Inequality and growth: evidence from panel cointegration. **The Journal of Economic Inequality,** v. 10, n. 4, p. 489-503, 2012. ISSN 1569-1721.

HESTON, A.; SUMMERS, R.; ATEN, B. Penn World Tables version 7.1 **Center for international comparisons of production, income and prices at the University of Pennsylvania**, 2012.

HEWITT, C. The effect of political democracy and social democracy on equality in industrial societies: A cross-national comparison. **American Sociological Review**, p. 450-464, 1977.

HOBSBAWM, E. J. **Globalização, democracia e terrorismo**. Editora Companhia das Letras, 2007.

HOGAN, M. C. et al. Maternal mortality for 181 countries, 1980–2008: a systematic analysis of progress towards Millennium Development Goal 5. **The Lancet,** v. 375, n. 9726, p. 1609-1623, 2010.

HOTELLING, H. Stability in Competition. **The Economic Journal**, p. 41-57, 1929. ISSN 0013-0133.

HOULE, C. Inequality and democracy: Why inequality harms consolidation but does not affect democratization. **World Politics,** v. 61, n. 04, p. 589-622, 2009. ISSN 1086-3338.

HUNTER, W.; POWER, T. J. Rewarding Lula: executive power, social policy, and the Brazilian elections of 2006. **Latin American Politics and Society,** v. 49, n. 1, p. 1-30, 2007. ISSN 1548-2456.

HUNTINGTON, S. P. **The third wave:** democratization in the late twentieth century. University of Oklahoma Press, 1993. ISBN 0806125160.

HUSTED, T. A.; KENNY, L. W. The Effect of the Expansion of the Voting Franchise on the Size of Government. **Journal of Political Economy**, p. 54-82, 1997. ISSN 0022-3808.

IM, H. B. Globalisation and democratisation: Boon companions or strange bedfellows? **Australian Journal of International Affairs,** v. 50, n. 3, p. 279-291, 1996. ISSN 1035-7718.

IVERSEN, T.; CUSACK, T. R. The causes of welfare state expansion: deindustrialization or globalization? **World politics,** v. 52, n. 03, p. 313-349, 2000. ISSN 1086-3338.

IVERSEN, T.; SOSKICE, D. An asset theory of social policy preferences. **American Political Science Review,** v. 95, n. 4, p. 875-894, 2001. ISSN 0003-0554.

JACKMAN, R. W. **Politics and social equality:** a comparative analysis. Wiley New York, NY, 1975.

JUSTMAN, M.; GRADSTEIN, M. The industrial revolution, political transition, and the subsequent decline in inequality in 19th-century Britain. **Explorations in Economic History,** v. 36, n. 2, p. 109-127, 1999. ISSN 0014-4983.

KALYVAS, S. N. **The rise of Christian democracy in Europe**. Cornell University Press, 1996.

KAUFMAN, R. R. Rule in Latin America: a concrete review of the bureaucratic-authoritarian model. **The new authoritarianism in Latin America**, p. 165, 1979.

KEY, V. **Southern politics in state and nation**. New York: Alfred A. Knopf, 1949.

KITSCHELT, H. **The transformation of European social democracy**. Cambridge University Press, 1994. ISBN 0521457157.

KOENKER, R. **Quantile regression**. Cambridge University Press, 2005. ISBN 0521608279.

KOENKER, R.; BASSETT JR, G. Regression quantiles. **Econometrica:** Journal of the Econometric Society, p. 33-50, 1978. ISSN 0012-9682.

KOHLI, A. et al. Inequality in the Third World An Assessment of Competing Explanations. **Comparative Political Studies,** v. 17, n. 3, p. 283-318, 1984. ISSN 0010-4140.

KRISTOV, L.; LINDERT, P.; MCCLELLAND, R. Pressure groups and redistribution. **Journal of Public Economics,** v. 48, n. 2, p. 135-163, 1992. ISSN 0047-2727.

KUZNETS, S. Economic growth and income inequality. **The American Economic Review**, p. 1-28, 1955. ISSN 0002-8282.

LAVER, M.; HUNT, W. B. **Policy and party competition**. Routledge, 1992. ISBN 0415902193.

LENSKI, G. E. **Power and privilege:** a theory of social stratification. UNC Press Books, 1966.

LI, H.; SQUIRE, L.; ZOU, H. F. Explaining international and intertemporal variations in income inequality. **The Economic Journal,** v. 108, n. 446, p. 26-43, 1998. ISSN 1468-0297.

LICIO, E. C.; RENNÓ, L. R.; CASTRO, H. C. D. O. D. Bolsa Família e voto na eleição presidencial de 2006: em busca do elo perdido. **Opinião Pública,** v. 15, n. 1, p. 31-54, 2009. ISSN 0104-6276.

LINDERT, P. H. The rise of social spending, 1880-1930. **Explorations in Economic History,** v. 31, n. 1, p. 1-37, 1994. ISSN 0014-4983.

LIPSET, S. M. Some Social Requisites of Democracy: Economic Development and Political Legitimacy. **The American Political Science Review,** v. 53, n. 1, p. 69-105, 1959.

LOTT JR, J.; KENNY, L. "How dramatically did women's suffrage change the size and scope of government?" John M. Olin**. Law & Economics Working Paper,** n. 60, 1999.

LUNDBERG, M.; SQUIRE, L. Growth and inequality: Extracting the lessons for policymakers. **Manuscript (February)**, 1999.

LUPU, N.; PONTUSSON, J. The structure of inequality and the politics of redistribution. **American Political Science Review,** v. 105, n. 02, p. 316-336, 2011. ISSN 1537-5943.

LUSTIG, N.; LOPEZ-CALVA, L. F.; ORTIZ-JUAREZ, E. Declining inequality in Latin America in the 2000s: the cases of Argentina, Brazil, and Mexico. **World Development,** v. 44, p. 129-141, 2013.

MAINWARING, S.; PÉREZ LIÑÁN, A. International Factors and Regime Change in Latin America, 1945-2005. APSA 2009. **Toronto Meeting Paper**, 2009.

MAQUIAVEL, N. **Comentários sobre a primeira década de Tito Lívio**. Tradução de Sérgio Bath. Brasília: Editora Universidade de Brasília, 1979.

MARES, I. **The politics of social risk:** business and welfare state development. Cambridge University Press, 2003. ISBN 0521534771.

______. Social Protection Around the World External Insecurity, State Capacity, and Domestic Political Cleavages. **Comparative Political Studies,** v. 38, n. 6, p. 623-651, 2005. ISSN 0010-4140.

MARSHALL, M. et al. **P**olity IV: 1800-1999. **Comparative Political Studies**, v. 35, p. 40-45, 2002.

MARSHALL, M.; JAGGERS, K.; GURR, T. R. **Polity IV Project**: Political Regime Characteristics and Transitions, 1800–2010. College Park, MD: University of Maryland, 2011.

MARX, K. **Luta de classes na França**. Buenos Aires: Anteo, 1972.

MCGUIRE, J. W. Basic health care provision and under-5 mortality: a cross-national study of developing countries. **World Development,** v. 34, n. 3, p. 405-425, 2006. ISSN 0305-750X.

MELTZER, A. H.; RICHARD, S. F. A rational theory of the size of government. **The Journal of Political Economy**, p. 914-927, 1981. ISSN 0022-3808.

MERTON, R. K. **The sociology of science:** Theoretical and empirical investigations. University of Chicago press, 1973. ISBN 0226520927.

MESCHI, E.; VIVARELLI, M. Trade and income inequality in developing countries. **World Development,** v. 37, n. 2, p. 287-302, 2009. ISSN 0305-750X.

MILANOVIC, B. **The Ricardian Vice:** Why Sala-I-Martin's calculations of world income inequality cannot be right. World Bank, Photocopy (September), 2002.

______. The two faces of globalization: against globalization as we know it. **World Development,** v. 31, n. 4, p. 667-683, 2003. ISSN 0305-750X.

______. Can we discern the effect of globalization on income distribution? Evidence from household surveys. **The World Bank Economic Review,** v. 19, n. 1, p. 21-44, 2005. ISSN 0258-6770.

MILL, J. S. **Representative Government.** History of Economic Thought Books, 1861.

MOBARAK, A. M. Democracy, volatility, and economic development. **Review of Economics and Statistics,** v. 87, n. 2, p. 348-361, 2005.

MOENE, K. O.; WALLERSTEIN, M. Inequality, social insurance, and redistribution. **American Political Science Review**, p. 859-874, 2001. ISSN 0003-0554.

______. Earnings inequality and welfare spending: a disaggregated analysis. **World Politics,** v. 55, n. 04, p. 485-516, 2003. ISSN 1086-3338.

MOON, B. E. **The political economy of basic human needs**. Cornell University Press, 1991. ISBN 0801499828.

MOORE, B. **Social origins of democracy and dictatorship**. Boston: Beacon, 1966.

MORIGUCHI, C.; SAEZ, E. The Evolution of Income Concentration in Japan, 1886-2005: Evidence from Income Tax Statistics. **The review of economics and statistics,** v. 90, n. 4, p. 713-734, 2008.

MUELLER, D. C.; STRATMANN, T. The economic effects of democratic participation. **Journal of Public Economics,** v. 87, n. 9, p. 2129-2155, 2003. ISSN 0047-2727.

MULLER, E. N. Democracy, economic development, and income inequality. **American Sociological Review**, p. 50-68, 1988. ISSN 0003-1224.

NECKERMAN, K. M.; TORCHE, F. Inequality: causes and consequences. **Annu. Rev. Sociol.,** v. 33, p. 335-357, 2007. ISSN 0360-0572.

NEE, V.; LIEDKA, R. Markets and inequality in the transition from state socialism. In: MIDLARSKY, M. I. (Ed.). **Inequality, democracy, and economic development**: Cambridge University Press, 1997.

NERI, M. C. **De Volta ao País do Futuro:** Projeções, Crise Europeia ea Nova Classe Média. Rio de Janeiro: FGV, 2012.

NICAISE, I. From Welfare to Work: The Role of Social Security Regulations. **The Margin,** v. 1, n. 2, p. 27-32, 1998.

NICOLAU, J.; PEIXOTO, V. As bases municipais da votação de Lula em 2006. **Cadernos do Fórum Nacional,** v. 6, p. 15-25, 2007.

NIELSEN, F.; ALDERSON, A. S. Income inequality, development, and dualism: Results from an unbalanced cross-national panel. **American Sociological Review**, p. 674-701, 1995. ISSN 0003-1224.

NOGUEIRA, C. The Influence of International Factors in the Process of Democratization. **Brazilian Political Science Review,** v. 3, n. 2, p. 172-179, 2011. ISSN 1981-3821.

ORTEGA, D.; RODRIGUEZ, F. Are capital shares higher in poor countries? Evidence from industrial surveys. **Manuscript, Corporacin Andina de Fomento (CAF) and IESA, and Department of Economics**, Wesleyan University, 2006.

PASTOR, J. M.; SERRANO, L. European integration and inequality among countries: a lifecycle income analysis. **Review of International Economics,** v. 20, n. 1, p. 186-199, 2012. ISSN 1467-9396.

PERSSON, T.; TABELLINI, G. **Democracy and development:** the devil in the details. National Bureau of Economic Research. 2006.

PIKETTY, T. **Capital in the Twenty-first Century**. Harvard University Press, 2014. ISBN 0674369548.

PIKETTY, T.; SAEZ, E. Income Inequality in the United States 1913–1998. **The Quaterly Journal of Economics,** v. CXVIII, n. 1, p. 1-39, 2003.

______. **The evolution of top incomes:** a historical and international perspective. National Bureau of Economic Research. 2006

POLANYI, K. The economy as instituted process. **Trade and market in the early empires,** v. 243, 1957.

______. **A grande transformação**. Leya, 2013. ISBN 972441759X.

POOLE, K. T.; ROSENTHAL, H. D-nominate after 10 years: A comparative update to congress: A political-economic history of roll-call voting. **Legislative Studies Quarterly**, p. 5-29, 2001. ISSN 0362-9805.

POSNER, D. N. The political salience of cultural difference: Why Chewas and Tumbukas are allies in Zambia and adversaries in Malawi. **American Political Science Review,** v. 98, n. 4, p. 529-545, 2004.

PRZEWORSKI, A. **Democracy and the market:** political and economic reforms in Eastern Europe and Latin America. Cambridge University Press, 1991. ISBN 052142335X.

______. **States and markets:** a primer in political economy. Cambridge University Press, 2003.

______. Conquered or granted? A history of suffrage extensions. **British Journal of Political Science,** v. 39, n. 02, p. 291-321, 2009. ISSN 1469-2112.

______. **Democracy and the limits of self-government**. Cambridge University Press, 2010.

______. Dinero, política y democracia. In: AMERICANOS, O. D. L. E. (Ed.). **Política, dinero y poder:** un dilema para las democracias de las Américas. México: Fondo de Cultura Economica, 2011a. p.67-88. (Colec. Política y Derecho).

______. Political Institutions and Political Events (PIPE) Data Set. **Department of Politics,** New York University, 2011b.

______. Democracy, redistribution, and Equality. **Brazilian Political Science Review,** v. 6, n. 1, 2012.

PRZEWORSKI, A. et al. **Democracy and Development:** Political Institutions and Well-Being in the World, 1950-1990 (Cambridge Studies in the Theory of Democracy). 2000.

______. ; SPRAGUE, J. **Paper stones:** a history of electoral socialism. University of Chicago Press Chicago, 1986. ISBN 0226684970.

______. ; WALLERSTEIN, M. Structural dependence of the state on capital. **American Political Science Review,** v. 82, n. 01, p. 11-29, 1988. ISSN 1537-5943.

QUINN, D. The correlates of change in international financial regulation. **American Political Science Review**, p. 531-551, 1997. ISSN 0003-0554.

RAJARATNAM, J. K. et al. Neonatal, postneonatal, childhood, and under-5 mortality for 187 countries, 1970–2010: a systematic analysis of progress towards Millennium Development Goal 4. **The Lancet,** v. 375, n. 9730, p. 1988-2008, 2010. ISSN 0140-6736.

REUVENY, R.; LI, Q. Economic Openness, Democracy, and Income Inequality An Empirical Analysis. **Comparative**

Political Studies, v. 36, n. 5, p. 575-601, 2003. ISSN 0010-4140.

ROBERTS, K. W. Voting over income tax schedules. **Journal of Public Economics,** v. 8, n. 3, p. 329-340, 1977. ISSN 0047-2727.

ROBINSON, J. A. The Political Economy Of Inequality. **Economic Research Forum Working Papers**, 2009.

RODRIK, D. **Why do more open economies have bigger governments?** National Bureau of Economic Research, 1996

______. **Democracies pay higher wages**. National bureau of economic research. 1998a

______. **Who needs capital-account convertibility?** A short paper for a Princeton International Finance Section symposium, 1998b. ISSN 0071-142X.

ROEMER, J. E. Why the poor do not expropriate the rich: an old argument in new garb. **Journal of Public Economics,** v. 70, n. 3, p. 399-424, 1998. ISSN 0047-2727.

______. The democratic political economy of progressive income taxation. **Econometrica,** v. 67, n. 1, p. 1-19, 1999. ISSN 1468-0262.

______. **Political competition:** theory and applications. Harvard University Press, 2009.

ROGERS, W. Quantile regression standard errors. **Stata Technical Bulletin,** v. 2, n. 9, 1993.

ROGOWSKI, R.; MACRAE, D. Inequality and Institutions: What Theory, History, and (Some) Data Tell Us. **Democracy, inequality and representation:** a comparative perspective, p. 354-386, 2008.

ROMER, T. Individual welfare, majority voting, and the properties of a linear income tax. **Journal of Public Economics,** v. 4, n. 2, p. 163-185, 1975. ISSN 0047-2727.

RONA-TAS, A. The first shall be last? Entrepreneurship and communist cadres in the transition from socialism. **American journal of Sociology**, p. 40-69, 1994. ISSN 0002-9602.

ROSS, M. Is democracy good for the poor? **American Journal of Political Science,** v. 50, n. 4, p. 860-874, 2006. ISSN 1540-5907.

RUBINSON, R.; QUINLAN, D. Democracy and social inequality: A reanalysis. **American Sociological Review**, p. 611-623, 1977. ISSN 0003-1224.

RUEDA, D. Political agency and institutions: Explaining the influence of left government and corporatism on inequality. **Democracy, inequality, and representation**, p. 169-200, 2008.

RUESCHEMEYER, D.; STEPHENS, E. H.; STEPHENS, J. D. **Capitalist development and democracy**. Cambridge, UK, 1992.

SAINT-PAUL, G.; VERDIER, T. Education, democracy and growth. **Journal of Development Economics,** v. 42, n. 2, p. 399-407, 1993. ISSN 0304-3878.

SAVUN, B.; TIRONE, D. C. Foreign aid, democratization, and civil conflict: how does democracy aid affect civil conflict? **American Journal of Political Science,** v. 55, n. 2, p. 233-246, 2011.

SCHEVE, K.; STASAVAGE, D. Institutions, partisanship, and inequality in the long run. **World Politics,** v. 61, n. 02, p. 215-253, 2009. ISSN 1086-3338.

SCHUMPETER, J. A. **Capitalism, socialism and democracy**. Routledge, 2013. ISBN 1134841515.

SEN, A. **Poverty and famines:** an essay on entitlement and deprivation. Oxford University Press, 1983. ISBN 0191037435.

______. **Development as freedom**. Oxford University Press, 1999. ISBN 0198297580.

SEN, A.; DREZE, J. **Hunger and public action**. Oxford: Clarendon Press, 1989.

SEN, A. K. **Collective choice and social welfare**. San Francisco: Holden Day, 1970.

SHANDRA, J. M. et al. Dependency, democracy, and infant mortality: a quantitative, cross-national analysis of less developed countries. **Social science & medicine,** v. 59, n. 2, p. 321-333, 2004. ISSN 0277-9536.

SIMPSON, M. Political rights and income inequality: A cross-national test. **American Sociological Review**, p. 682-693, 1990. ISSN 0003-1224.

SIROWY, L.; INKELES, A. The effects of democracy on economic growth and inequality: a review. **Studies in Comparative International Development,** v. 25, n. 1, p. 126-157, 1990. ISSN 0039-3606.

SOLT, F. Standardizing the world income inequality database. **Social Science Quarterly,** v. 90, n. 2, p. 231-242, 2009. ISSN 1540-6237.

SPENCE, M.; HLATSHWAYO, S. The evolving structure of the American economy and the employment challenge.

Comparative Economic Studies, v. 54, n. 4, p. 703-738, 2012. ISSN 0888-7233.

STACK, S. The effects of political participation and socialist party strength on the degree of income inequality. **American Sociological Review**, p. 168-171, 1979. ISSN 0003-1224.

______. The political economy of income inequality: A comparative analysis. **Canadian Journal of Political Science,** v. 13, n. 02, p. 273-286, 1980. ISSN 1744-9324.

STAIGER, D.; STOCK, J. H. Instrumental variables regression with weak instruments. **Econometrica,** v. 65, n. 3, p. 557-586, 1997.

STANISZKIS, J. **The Dynamics of Breakthrough in Eastern Europe, Berkeley**: CA: University of California Press 1991.

STOCK, J. H.; WRIGHT, J. H.; YOGO, M. A survey of weak instruments and weak identification in generalized method of moments. **Journal of Business & Economic Statistics,** v. 20, n. 4, 2002.

SVOLIK, M. W. **The politics of authoritarian rule**. Cambridge University Press, 2012. ISBN 1139561073.

SWANK, D. Withering welfare? Globalisation, political economic institutions, and contemporary welfare states. **Cambridge studies in international relations,** v. 86, p. 58-82, 2003. ISSN 0959-6844.

SWENSON, P. **Capitalists against markets:** the making of labor markets and welfare states in the United States and Sweden. Oxford University Press, 2002. ISBN 0195142977.

SYLWESTER, K. Can education expenditures reduce income inequality? **Economics of Education Review,** v. 21, n. 1, p. 43-52, 2002. ISSN 0272-7757.

SZELENYI, I.; MANCHIN, R. Social policy under state socialism: market, redistribution, and social inequalities in East European socialist societies. **Stagnation and renewal in social policy**, p. 102-139, 1987.

TEORELL, J. et al. **The Quality of Government Dataset, version 15 May 2013**. The Quality of Government Institute. University of Gothenburg 2013.

TIMMONS, J. F. Does democracy reduce economic inequality? **British Journal of Political Science,** v. 40, n. 04, p. 741-757, 2010. ISSN 1469-2112.

UNU/WIDER-UNDP. World Income Inequality Database - User Guide and Data Sources.

VREELAND, J. R. A continuous Schumpeterian conception of democracy. **Annual Meeting of the Public Choice Society and Economic Science Association**, Nashville, 2003.

WALLERSTEIN, M. Wage-setting institutions and pay inequality in advanced industrial societies. **American Journal of Political Science**, p. 649-680, 1999. ISSN 0092-5853.

WALLERSTEIN, M.; GOLDEN, M.; LANGE, P. Unions, employers' associations, and wage-setting institutions in Northern and Central Europe, 1950-1992. **Industrial and Labor Relations Review**, p. 379-401, 1997. ISSN 0019-7939.

WEEDE, E. The Effects of Democracy and Socialist Strength on the Size Distribution of Income Some more Evidence. **International Journal of Comparative Sociology,** v. 23, n. 3-4, p. 151-165, 1982. ISSN 0020-7152.

WEEDE, E.; TIEFENBACH, H. Some recent explanations of income inequality: an evaluation and critique. **International Studies Quarterly**, p. 255-282, 1981. ISSN 0020-8833.

WEJNERT, B. Diffusion, development, and democracy, 1800-1999. **American Sociological Review,** v. 70, n. 1, p. 53-81, 2005. ISSN 0003-1224.

WHITEHEAD, L. Three international dimensions of democratization. **The International Dimensions of Democratization:** Europe and the Americas, p. 3-25, 1996.

WHYTE, M. **Myth of the social volcano:** perceptions of inequality and distributive injustice in contemporary China. Stanford University Press, 2010. ISBN 0804769419.

WOOD, A. **North-South trade, employment and inequality**. Oxford: Clarendon Press, 1994.

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. MIT press, 2010. ISBN 0262232588.

ZHAO, S. A tragedy of history: The Chinese search for democracy in the twentieth century. **The Journal of Contemporary China,** v. 2, n. 3, p. 18-37, 1993. ISSN 1067-0564.

ZHOU, X. Economic transformation and income inequality in urban China: evidence from panel data. **American Journal of Sociology**, p. 1135-1174, 2000. ISSN 0002-9602.

ZUCCO, C. The president's 'new'constituency: Lula and the pragmatic vote in Brazil's 2006 presidential elections. **Journal of Latin American Studies,** v. 40, n. 1, p. 29-49, 2008. ISSN 1469-767X.